Controle de Posição

Relatório de Definições de Mensagens

Este documento descreve o conjunto de mensagens e arquivos do sistema de Controle de Posição, que permitem aos participantes efetuar a consulta de posições em aberto, a consulta de quebra de estratégias e a realização de transferência de posição de derivativos.

A implantação da integração das clearings da BM&FBOVESPA e do novo sistema de risco CORE (Closeout Risk Evaluation) depende de prévia autorização dos órgãos reguladores.

Histórico de Revisão

Data	Versão	Descrição	Responsável
30/04/2014	2.0	Criação e alteração de mensagens	
15/06/2015	2.1	Criação e alteração de mensagens	
31/07/2015	2.2	Inclusão das mensagens de: • Update e liquidação de aluguel de ativos Criação das mensagens de: • Liquidação do dia de termo de ações de aluguel de ativos; • Solicitações e liquidações projetadas de termo de ações de aluguel de ativos;	

Descrição detalhada no documento “Histórico de Alterações”.

Versão de Schema

A versão deste catálogo contempla as versões abaixo dos schemas XSDs.

Nome Mensagem	Versão Schema XSD
bvmf.025.01	1.9
bvmf.026.01	1.9
SUPL.026.01	1.8
bvmf.027.02	2.0
bvmf.028.02	1.8
bvmf.030.01	1.8
bvmf.031.02	2.0
bvmf.032.01	1.8
bvmf.033.01	1.8
bvmf.034.01	1.0
bvmf.076.01	1.8
bvmf.077.01	1.10
bvmf.094.01	1.10
bvmf.095.01	1.9
bvmf.096.01	1.10
bvmf.097.02	2.0
bvmf.098.02	2.0
bvmf.099.01	1.9
bvmf.115.01	1.0
bvmf.116.01	1.0
bvmf.171.01	1.0
bvmf.172.01	1.0
bvmf.173.01	1.0
bvmf.174.01	1.0

Nome Mensagem	Versão Schema XSD
bvmf.175.01	1.0
bvmf.176.01	1.0
bvmf.129.01	1.1
bvmf.130.01	1.1
bvmf.131.01	1.1
bvmf.132.01	1.0
bvmf.133.01	1.1
bvmf.134.01	1.1
bvmf.135.01	1.0
bvmf.136.01	1.0
bvmf.138.01	1.0
bvmf.139.01	1.0
bvmf.179.01	1.0
bvmf.185.01	1.0

Descrição detalhada no documento “Manual Técnico”.

Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN

Mensagem somente atendem a Clearing de Derivativos (V1 IPN)	Mensagem pode sofrer ajuste para atender Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada (V2 do IPN)	Mensagem revisada para atender V2 do IPN	Novas Mensagens para Clearing de Renda Variável e Renda Fixa Privada
BVBG.016.01 DerivativesPositionMovement	bvmf.082.01 AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice	BVBG.017.02 PositionReportAccountLevel	bvmf.115.01 BlockExerciseInstruction
bvmf.076.01 StrategyBreakdownRequest	bvmf.083.01 AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse	bvmf.028.02 PositionTransferInstruction	bvmf.116.01 BlockExerciseStatusAdvice
BVBG.027.01 StrategyBreakdownResponse	bvmf.084.01 AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest	bvmf.030.01 PositionTransferCancellation	bvmf.171.01EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest
		bvmf.031.02 PositionTransferStatusAdvice	bvmf.172.01EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice
		bvmf.033.01 InformationPositionTransferReceiverLeg	bvmf.173.01CustodianIndicationApprovalRequest
		bvmf.032.01 RequestPositionTransferStatus	bvmf.174.01EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse
		bvmf.026.01 SecuritiesStatementQueryV02	bvmf.175.01EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest
			bvmf.176.01EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest
			bvmf.129.01 ContractModificationInstruction
			bvmf.130.01 ContractRenewalInstruction
			bvmf.131.01 ContractEarlySettlementInstruction

			bvmf.133.01 ContractStatusAdvice
			bvmf.134.01 ContractModificationAdvice
			bvmf.135.01 ContractRenewalApprovalRequest
			bvmf.136.01 ContractEarlySettlementApprovalRequest
			bvmf.138.01 ContractApprovalResponse
			BVBG.061.01 ContractModificationReport
			bvmf.132.01 ContractCancellationInstruction
			bvmf.139.01 ContractModificationReport
			BVBG.062.01 ContractSettlementReport
			BVBG.063.01 EarlySettlementReport

Conteúdo

Histórico de Revisão 2
Versão de Schema 3
Status das Mensagens e Arquivos no Projeto IPN 5
Visão geral 24
Escopo 24
Lista de Mensagens e Arquivos 24
Conteúdo do Arquivo 31
Como Ler 32
Fluxo de Mensagens: 33
Informa Posição em aberto 33
Cenário 1- Participante requisita arquivo de posição em aberto 33
Cenário 2- BVMF informa arquivo de posição em aberto ao final do dia 34
Cenário 3- Participante requisita arquivo de posição em aberto 35
Informa detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos 36
Cenário 1:BVMF informa ao PNP e PL detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos 36
Informa Quebra de Estratégia 37
Cenário 1: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia 37
Cenário 2: BM&F Informa resultado de quebra de estratégia 38
Cenário 3: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia 39

Informa Bloqueio de Exercício....40
Cenário 1- Participante solicita bloqueio de exercício....40
Cenário 2- Participante solicita bloqueio de exercício....41
Liquidação Antecipada de Termo....42
Cenário 1- Participante solicita liquidação antecipada de termo....42
Cenário 2- Participante solicita liquidação antecipada de termo com erro....43
Cenário 3- Participante solicita cancelamento de liquidação antecipada de termo....44
Cenário 4- Participante solicita cancelamento de liquidação antecipada de termo com erro....45
Cenário 5- Custodiante aprova ou rejeita cancelamento de liquidação antecipada com direcionamento de custodia....46
Cenário 6- Custodiante aprova ou rejeita cancelamento de liquidação antecipada com direcionamento de custodia com erro....48
Direcionamento de Custodiante na Liquidação de Termo....49
Cenário 1- Participante Solicita Direcionamento de Custodiante na Liquidação de Termo....49
Cenário 2- Participante Solicita Direcionamento de Custodiante na Liquidação de Termo com Erro....51
Cenário 3- Custodiante aprova ou rejeita direcionamento de custodiante com erro....52
Cenário 4- Participante solicita cancelamento de direcionamento de custodia....53
Cenário 5- Participante solicita cancelamento de direcionamento de custodiante com erro....55
Cenário6- Custodiante aprova ou rejeita cancelamento de direcionamento de custodia com erro....56
Fluxos de Transferência de Posição....57
Os fluxos de transferência de posição estão contemplados no Anexo I.....57
Solicitação de alteração de atributos do Contrato de Aluguel de Ativos em aberto....58

Cenário 1- Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Solicita Alteração de Contrato de Aluguel de Ativos com Sucesso 58
Cenário 2- Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Solicita Alteração dados de Custodiantes no Contrato de Aluguel De Ativos com Sucesso 60
Cenário 3- Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Solicita Alteração de Custodiante com Sucesso 61
Cenário 4- Solicitação de Alteração de Contrato Aluguel De Ativos (dados de Custodiantes ou não) com Erro 63
Cenário5- Aprovação de Alteração de Contrato Aluguel de Ativos (dados de Custodiantes ou não) com Erro 64
Solicitação de renovação do Contrato de Aluguel de Ativos em aberto 65
Cenário 1- Renovação de Aluguel de Ativos pelo Doador com sucesso 65
Cenário 2- Renovação de Aluguel de Ativos pelo Tomador com sucesso 67
Cenário 3- Solicitação de Renovação de Contrato Aluguel de Ativos com Erro 69
Cenário 4- Aprovação de Renovação de Contrato Aluguel de Ativos com Erro 70
Solicitação de Liquidação Antecipada do Contrato de Aluguel de Ativos em aberto 71
Cenário 1- Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Destino Tomador Solicita Liquidação Antecipada de Contrato de Aluguel de Ativos com Sucesso 71
Cenário 2- Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Doador Solicita Liquidação Antecipada de Contrato de Aluguel de Ativos com Sucesso 73
Cenário 3- Solicitação de Liquidação Antecipada de Contrato Aluguel de Ativos com Erro 74
Cenário 4- Aprovação de Liquidação Antecipada de Contrato Aluguel de Ativos com Erro 75
Cancelamento de Alteração, Renovação ou Liquidação Antecipada do Contrato de BTC em aberto 76
Cenário 1- Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Solicita Cancelamento de Alteração, Renovação ou Liquidação Antecipada de Contrato de BTC com Sucesso 76

Cenário 2- Solicitação de Cancelamento e Alteração, Renovação ou Liquidação Antecipada de Contrato de BTC com Erro 78
Informa contratos alterados 79
Cenário1- BM&FBOVESPA informa os contratos alterados ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes. 79
Informa Liquidações de Contratos Derivativos Não Fungíveis e Aluguel de Ativos do Dia 80
Cenário1- BM&FBOVESPA informa as liquidações dos contratos de derivativos não fungíveis e aluguel de ativos do dia ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação e Custodiantes. 80
Informa Liquidações Antecipadas de Contratos Derivativos Não Fungíveis e Aluguel de Ativos 81
Cenário1- BM&FBOVESPA informa liquidações antecipadas dos contratos de derivativos não fungíveis e aluguel de ativos ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação e Custodiantes. 81
bvmf.026.01 - Mensagem de Solicitação do Arquivo de Posição em Aberto (SecuritiesStatementQueryV02) 82
Funcionalidade da Mensagem 82
Escopo 82
Uso 82
Diagrama da Mensagem 82
Diagrama do Supplementary Data 83
Regras 85
Estrutura da mensagem bvmf.026.01 - SecuritiesStatementQueryV02 85
Estrutura da mensagem Supplementary Data - SUPL.026.01 - SecuritiesStatementQuerySD 88
BVBG.017.02 – Arquivo de posição em aberto nível de conta (PositionReportAccountLevel) 91
bvmf.027.02 – FungibleDerivativesPositionReport 92
Funcionalidade da Mensagem 92

Escopo....92
Uso....92
Diagrama da Mensagem....93
Regras....95
Estrutura da Mensagem bvmf.027.02 – FungibleDerivativesPositionReport....95
bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport....111
Funcionalidade da Mensagem....111
Escopo....111
Uso....111
Diagrama da Mensagem....111
Regras....112
Estrutura da Mensagem bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport....113
bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport....119
Funcionalidade da Mensagem....119
Escopo....119
Uso....119
Diagrama da Mensagem....120
Regras....121
Estrutura da Mensagem bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport....121
bvmf.096.01 – BuyInPositionReport....127

Funcionalidade da Mensagem....127
Escopo....127
Uso....127
Diagrama da Mensagem....127
Regras....128
Estrutura da Mnesagem bvmf.096.01 – BuyInPositionReport....129
bvmf.097.02 – CashMarketPositionReport....135
Funcionalidade da Mensagem....135
Escopo....135
Uso....135
Diagrama da Mensagem....135
Regras....136
Estrutura da Mensagem bvmf.097.02 – CashMarketPositionReport....137
bvmf.098.02 – NonFungibleDerivativesPositionReport....144
Funcionalidade da Mensagem....144
Escopo....144
Uso....144
Diagrama da Mensagem....145
Regras....146
Estrutura da Mensagem bvmf.098.02 – NonFungibleDerivativesPositionReport....146

bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport 158
Funcionalidade da Mensagem 158
Escopo 158
Uso 158
Diagrama da Mensagem 159
Regras 160
Estrutura da Mensagem bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport 160
bvmf.034.01 – SecuritiesLendingPositionReport 164
Funcionalidade da Mensagem 164
Escopo 164
Uso 164
Diagrama da Mensagem 165
Regras 166
Estrutura da Mensagem bvmf.034.01 – SecuritiesLendingPositionReport 166
BVBG.016.01 – Arquivo de Movimentação de Posição de Derivativos (“DerivativesPositionMovement”) 179
Funcionalidade do Arquivo 179
Escopo 179
Uso 180
Diagrama da Mensagem bvmf.025.01 180
Regras 182

Estrutura da Mensagem bvmf.025.01 – DerivativesPositionMovement 182
bvmf.076.01 - StrategyBreakdownRequest 194
Funcionalidade da Mensagem 194
Escopo 194
Uso 194
Diagrama da Mensagem 195
Regras 196
Estrutura da Mensagem bvmf.076.01 – StrategyBreakdownRequest 196
BVBG.027.01 – StrategyBreakdownResponse 199
Funcionalidade da Mensagem 199
Escopo 199
Uso 199
Diagrama da Mensagem 200
Regras 201
Estrutura da Mensagem bvmf.077.01 – StrategyBreakdownResponse 201
bvmf.028.02 – PositionTransferInstruction 211
Funcionalidade da Mensagem 211
Escopo 211
Uso 211
Diagrama da Mensagem 211

Regras 213
Estrutura da Mensagem 213
bvmf.030.01 – PositionTransferCancellation 219
Funcionalidade da Mensagem 219
Escopo 219
Uso 219
Diagrama da Mensagem 220
Regras 220
Estrutura da Mensagem 220
bvmf.031.02 – PositionTransferStatusAdvice 222
Funcionalidade da Mensagem 222
Escopo 222
Uso 222
Diagrama da Mensagem 225
Regras 225
Estrutura da Mensagem 226
bvmf.032.01 – RequestPositionTransferStatus 236
Funcionalidade da Mensagem 236
Escopo 236
Uso 236

Diagrama da Mensagem 237
Regras 237
Estrutura da Mensagem 237
bvmf.033.01 – InformationPositionTransferReceiverLeg 239
Funcionalidade da Mensagem 239
Escopo 239
Uso 239
Diagrama da Mensagem 240
Regras 240
Estrutura da Mensagem 241
bvmf.082.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice 244
Funcionalidade da Mensagem 244
Escopo 244
Uso 244
Diagrama da Mensagem 245
Regras 247
Estrutura da mensagem 247
bvmf.083.01– AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse 251
Funcionalidade da Mensagem 251
Escopo 252

Uso 252
Diagrama da Mensagem 252
Estrutura da mensagem 253
bvmf.084.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest 255
Funcionalidade da Mensagem 255
Escopo 255
Diagrama da Mensagem 255
Estrutura da mensagem 256
bvmf.115.01 - BlockExerciseInstruction 257
Funcionalidade da Mensagem 257
Escopo 257
Uso 257
Diagrama da Mensagem 257
Regras 258
Estrutura da mensagem bvmf.115.01 – BlockExerciseInstruction 259
bvmf.116.01 -BlockExerciseStatusAdvice 261
Funcionalidade da Mensagem 261
Escopo 261
Uso 261
Diagrama da mensagem 262

Regras 263
Estrutura 263
bvmf.171.01 - EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest 265
Funcionalidade da Mensagem 265
Escopo 265
Uso 265
Diagrama da Mensagem 265
Regras 267
Estrutura da mensagem bvmf.171.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest 267
bvmf.172.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice 269
Funcionalidade da Mensagem 269
Escopo 269
Uso 269
Diagrama da Mensagem 269
Regras 271
Estrutura da mensagem bvmf.172.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice 271
bvmf.173.01- CustodianIndicationApprovalRequest 273
Funcionalidade da Mensagem 273
Escopo 273
Uso 274

Diagrama da Mensagem 274
Regras 275
Estrutura da mensagem bvmf.173.01- CustodianIndicationApprovalRequest 275
bvmf.174.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse 278
Funcionalidade da Mensagem 278
Escopo 278
Uso 279
Diagrama da Mensagem 279
Regras 280
Estrutura da mensagem bvmf.174.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse 280
bvmf.175.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest 282
Funcionalidade da Mensagem 282
Escopo 282
Uso 282
Diagrama da Mensagem 282
Regras 283
Estrutura da mensagem bvmf.175.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest 283
bvmf.176.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest 284
Funcionalidade da Mensagem 284
Escopo 284

Uso 284
Diagrama da Mensagem 284
Regras 285
Estrutura da mensagem bvmf.176.01EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest 285
bvmf.129.01 - ContractModificationInstruction 288
Funcionalidade da Mensagem 288
Escopo 288
Diagrama da Mensagem 289
Regras 290
Estrutura da Mensagem 290
bvmf.130.01 - ContractRenewalInstruction 293
Funcionalidade da Mensagem 293
Escopo 293
Diagrama da Mensagem 293
Regras 295
Estrutura da Mensagem 295
bvmf.131.01 - ContractEarlySettlementInstruction 297
Funcionalidade da Mensagem 298
Escopo 298
Diagrama da Mensagem 299

Regras 299
Estrutura da Mensagem 300
bvmf.132.01 - ContractCancellationInstruction 302
Funcionalidade da Mensagem 302
Escopo 302
Diagrama da Mensagem 302
Regras 303
Estrutura da Mensagem 303
bvmf.133.01 - ContractStatusAdvice 306
Funcionalidade da Mensagem 306
Escopo 306
Diagrama da Mensagem 306
Regras 308
Estrutura da Mensagem 308
bvmf.134.01 - ContractModificationAdvice 311
Funcionalidade da Mensagem 311
Escopo 311
Diagrama da Mensagem 312
Regras 313
Estrutura da Mensagem 314

bvmf.135.01 - ContractRenewalApprovalRequest 323
Funcionalidade da Mensagem 323
Escopo 323
Diagrama da Mensagem 324
Regras 325
Estrutura da Mensagem 325
bvmf.136.01 - ContractEarlySettlementApprovalRequest 328
Funcionalidade da Mensagem 328
Escopo 328
Diagrama da Mensagem 329
Regras 329
Estrutura da Mensagem 329
bvmf.138.01 - ContractApprovalResponse 332
Funcionalidade da Mensagem 332
Escopo 332
Diagrama da Mensagem 332
Regras 333
Estrutura da Mensagem 334
BVBG.061.01 - ContractModificationReport 336
Funcionalidade do Arquivo 336

Escopo....336
Diagrama da Mensagem....336
Regras....337
Estrutura da Mensagem....337
BVBG.062.01 - ContractSettlementReport....347
Funcionalidade do Arquivo....347
Escopo....347
Diagrama da Mensagem....347
Regras....348
Estrutura da Mensagem....349
BVBG.063.01 - EarlySettlementReport....362
Funcionalidade do Arquivo....362
Escopo....362
Diagrama da Mensagem....362
Regras....363
Estrutura da Mensagem....364

Visão geral

Escopo

Este documento descreve o conjunto de mensagens e arquivos do sistema de Controle de Posição, que permitem aos participantes efetuar a consulta de posições em aberto, a consulta de quebra de estratégias e a realização de transferência de posição de derivativos.

Cenários de negócios foram modelados e uma série de mensagens XML foram concebidas. No devido tempo, essas mensagens serão submetidos à ISO20022, órgão de registro, para aprovação. Cada cenário de negócios é representado por um fluxo de trabalho padronizado e um número fixo de mensagens normatizadas.

Lista de Mensagens e Arquivos

bvmf.026.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Posição em Aberto (“SecuritiesStatementQueryV02”)

- Mensagem onde MCs, PNPs, PLs e Custodiantes podem solicitar de forma intradiária as informações momentâneas de posições em aberto nos mercados da BM&FBOVESPA atendidos pelo sistema de Controle de Posição. Os custodiantes somente podem solicitar informações referente a posições no mercado à vista, de falha de entrega e recompra.

BVBG.017.02 – Arquivo de posição em aberto no nível de conta (“PositionReportAccountLevel”)

- O arquivo de posição em aberto no nível de conta é gerado sob demanda como resposta da mensagem de solicitação BVMF.026.01, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver posição em aberto para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

BVBG.016.01 – Arquivo de Movimentação de Posição de Derivativos (“DerivativesPositionMovement”)

- Arquivo gerado para PNPs e PLs, no final de cada data de movimento, com detalhes dos negócios efetuados nos mercados de derivativos fungíveis da BM&FBOVESPA.

bvmf 076.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownRequest”)

- O sistema de controle de posições é responsável por efetuar a quebra dos negócios de estratégia realizados no mercado de derivativos financeiros e de commodities. Através desta mensagem os PNPs e PLs podem solicitar de forma intradiária o arquivo com o resultado momentâneo do processo de quebra de estratégias.

BVBG.027.01 – Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownResponse”)

- O arquivo de quebra de estratégia é gerado sob demanda como resposta da mensagem de solicitação BVMF.076.01, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

bvmf.028.02 – Solicitação de transferência de posição (“PositionTransferInstruction”)

- Mensagem onde os PNPs ou PLs podem solicitar a transferência de posição de derivativos fungíveis, não fungíveis e aluguel de ativos.

bvmf.030.01 – Solicitação de cancelamento de transferência (“PositionTransferCancellation”)

- Mensagem onde os PNPs ou PLs, origem ou destino de transferência, podem solicitar o cancelamento da transferência de posição.

bvmf.031.02 – Status da transferência (“PositionTransferStatusAdvice”)

- Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência são informados do status da mesma.

bvmf.032.01 – Solicitação de status da transferência (“RequestPositionTransferStatus”)

- Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência podem solicitar a mensagem de status da transferência.

bvmf.033.01 – Recebimento de transferência (“InformationPositionTransferReceiverLeg”)

- Mensagem onde o PNP ou PL destino recebe a transferência no sistema.

bvmf.082.01 – AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice

- A mensagem IntradayRiskLimitRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação informando a avaliação de risco de transferência de posição.

bvmf.083.01 – AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse

- A mensagem AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse é enviada pelo Membro de Compensação à BM&FBOVESPA para informar a aceitação ou rejeição da avaliação de risco de transferência de posição.

bvmf.084.01 – AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest

- A mensagem AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação à BM&FBOVESPA como requisição das informações atualizada da avaliação do risco de transferência de posição.

bvmf.115.01 – BlockExerciseInstruction

- A mensagem BlockExerciseInstruction é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA para solicitar o bloqueio de exercício total ou parcial.

bvmf.116.01 – BlockExerciseStatusAdvice

- A mensagem BlockExerciseStatusAdvice é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação informando a situação do bloqueio de exercício.

bvmf.171.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest

- A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação comprador à BM&FBOVESPA para solicitar a liquidação antecipada de termo ou direcionamento de custodiante para liquidação do termo no vencimento do contrato.

bvmf.172.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice

- A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice pela BM&FBOVESPA ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação (comprador e vendedor) e Custodiante para informar o status da liquidação da antecipada ou do direcionamento de custodiante.

bvmf.173.01 – CustodianIndicationApprovalRequest

- A mensagem CustodianIndicationApprovalRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Custodiante, para requisitar confirmação de direcionamento de custodiante.

bvmf.174.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse

- A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse é enviada pelo Custodiante à BM&FBOVESPA com a aprovação ou rejeição da solicitação de liquidação antecipada e direcionamento de custodiante. Esta mensagem também é utilizada pela contraparte do contrato para aprovar ou reprovar a liquidação antecipada, quando aplicável.

bvmf.175.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest

- A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação comprador à BM&FBOVESPA solicitando o cancelamento da liquidação antecipada de termo ou direcionamento de custodia.

bvmf.176.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest

- A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Custodiante como requisição de confirmação de cancelamento de liquidação antecipada de termo ou direcionamento de custódia. Esta mensagem também é enviada para contraparte do contrato para aprovar ou reprovar o cancelamento da liquidação antecipada, quando aplicável.

bvmf.129.01 – ContractModificationInstruction

- A mensagem ContractModificationInstruction <bvmf.129.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor da posição do contrato de Aluguel de Ativos à BM&FBOVESPA, como requisição de alteração de dados do Contrato de Aluguel de Ativos e/ou alteração de Custodiante.

bvmf.130.01 – ContractRenewalInstruction

- A mensagem ContractRenewalInstruction <bvmf.130.02> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno , parte executora da oferta do contrato de aluguel de ativos tanto como doador ou tomador, ou Participante de Liquidação Doador à BM&FBOVESPA, como requisição de renovação do Contrato de Aluguel de Ativos.

bvmf.131.01 – ContractEarlySettlementInstruction

- A mensagem ContractEarlySettlementInstruction <bvmf.131.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor das posição do contrato de Aluguel de Ativos à BM&FBOVESPA, como requisição de liquidação antecipada do Contrato de Aluguel de Ativos.

bvmf.132.01 – ContractCancellationInstruction

- A mensagem ContractCancellationInstruction <bvmf.132.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA, como requisição de cancelamento de alteração, renovação ou liquidação antecipada do Contrato de BTC.

bvmf.133.01 – ContractStatusAdvice

- A mensagem ContractStatusAdvice <bvmf.133.01> é enviada pela BM&FBOVESPA aos Participantes informando a situação da alteração, renovação ou liquidação antecipada de contrato de Aluguel de Ativos.

bvmf.134.01 – ContractModificationAdvice

- A mensagem ContractModificationAdvice <bvmf.134.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor da posição de aluguel de ativos ou Custodiante Origem, como requisição para aprovação de alteração de contrato de aluguel.

Também é enviado ao Custodiante Destino para aprovação de troca de custodiante.

bvmf.135.01 – ContractRenewalApprovalRequest

- A mensagem ContractRenewalApprovalRequest <bvmf.135.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno -executor da oferta do contrato de aluguel de ativos ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes, como requisição para aprovação da renovação do contrato de Aluguel de Ativos.

bvmf.136.01 – ContractEarlySettlementApprovalRequest

- A mensagem ContractEarlySettlementApprovalRequest <bvmf.136.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Custodiante Tomador solicitando a aprovação da liquidação antecipada do contrato de Aluguel de Ativos.

bvmf.138.01 – ContractApprovalResponse

- A mensagem ContractApprovalResponse <bvmf.138.01> é enviada pelos Participantes à BM&FBOVESPA, com a aprovação ou rejeição da alteração, renovação ou liquidação anteciapada de contrato de Aluguel de Ativos.

BVBG.061.01 – ContractModificationReport

- O arquivo ContractModificationReport <BVBG.061.01> é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes para informar os contratos alterados.

BVBG.062.01 – ContractSettlementReport

- O arquivo ContractSettlementReport <BVBG.062.01> é enviado pela BM&FBOVESPA ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes para informar os contratos de derivativos não fungíveis e de aluguel de ativos que serão liquidados no dia.

BVBG.063.01 –EarlySettlementReport

- O arquivo EarlySettlementReport <BVBG.063.01> é enviado pela BM&FBOVESPA ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes para informar liquidações antecipadas dos contratos de derivativos não fungíveis e de aluguel de ativos.

Conteúdo do Arquivo

Sigla do Arquivo	Nome do Arquivo	Conteúdo do Arquivo
BVBG.016.01	DerivativesPositionMovement	bvmf.025.01- DerivativesPositionMovement
BVBG.017.02	PositionReportAccountLevel	bvmf.027.02 – FungibleDerivativesPositionReport bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport bvmf.096.01 – BuyInPositionReport bvmf.097.02 – CashMarketPositionReport bvmf.098.02 – NonFungibleDerivativesPositionReport bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport bvmf.034.01 – SecuritiesLendingPositionReport
BVBG.027.01	StrategyBreakdownResponse	bvmf.077.01- StrategyBreakdownResponse
BVBG.061.01	ContractModificationReport	bvmf.139.01 – ContractModificationReport
BVBG.062.01	ContractSettlementReport	bvmf.179.01 – ContractSettlementReport
BVBG.063.01	EarlySettlementReport	bvmf.185.01 – EarlySettlementReport

Como Ler

UML (Unified Modeling Language) tem sido usada para descrever modelos de negócio e lógica. Como o conhecimento de UML não é um requisito para discutir os negócios padrões, o formato de dados para as mensagens é apresentado de uma forma mais amigável. Esta forma de representação é gerada automaticamente a partir dos modelos, garantindo assim, a coerência absoluta entre as informações do modelo com a norma publicada.

Fluxo de Mensagens:

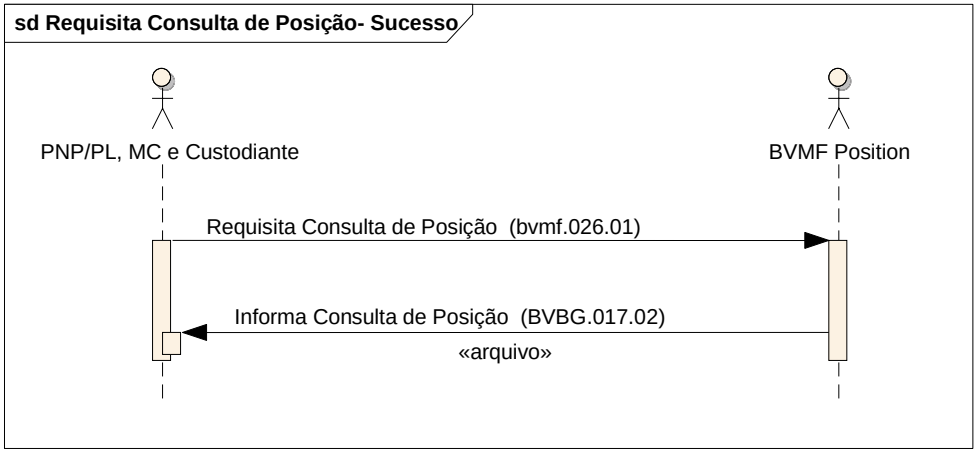
Informa Posição em aberto

Cenário 1- Participante requisita arquivo de posição em aberto

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de posição em aberto oriunda de um PNP, PL, MC ou Custodiante.

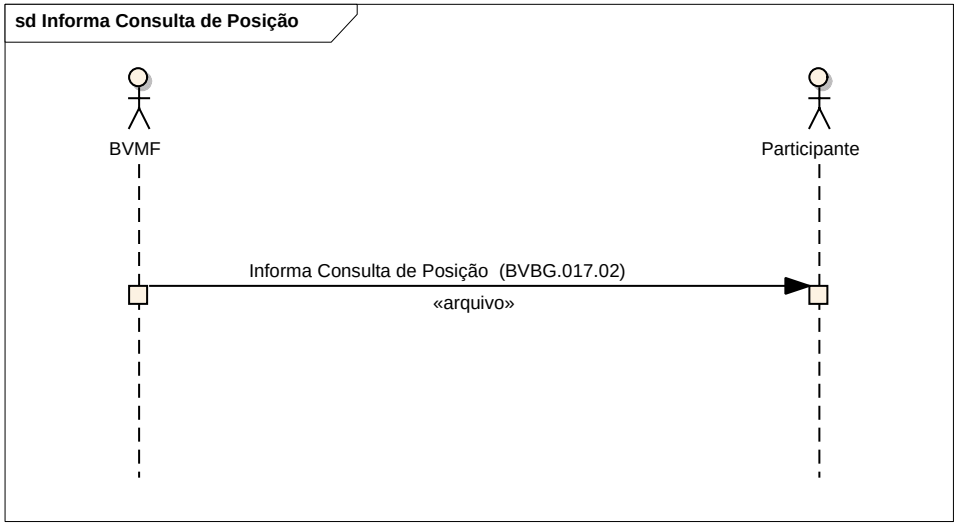
-O Participante envia a mensagem de solicitação do arquivo de posição em aberto "SecuritiesStatementQueryV02"(bvmf.026.01). Os custodiantes somente podem solicitar informações referentes a posições no mercado à vista, de falha de entrega e recompra.

- Quando o arquivo é totalmente processado, a BM&FBOVESPA envia o arquivo de posição no nível de conta BVBG017.02-PositionReportAccountLevel. Se não houver posição em aberto para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.



Cenário 2- BVMF informa arquivo de posição em aberto ao final do dia

O fluxo abaixo ilustra o envio, ao final do dia, aos PNPs, PLs, MCs e Custodiantes, do arquivo de posição em aberto BVBG017.02-PositionReportAccountLevel no encerramento da data de movimento. ..



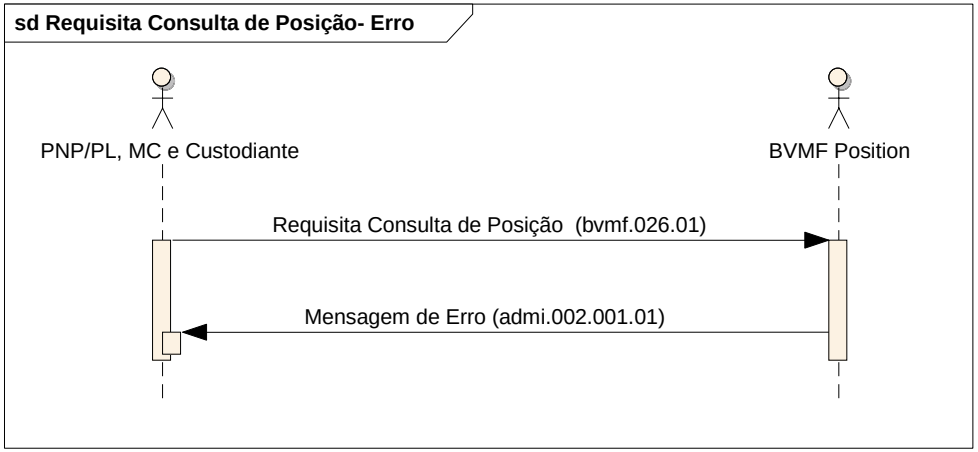
Cenário 3- Participante requisita arquivo de posição em aberto

Cenário de Erro

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de posição em aberto oriunda de um PNP, PL, MC ou Custodiante.

-O Participante envia a mensagem de solicitação do arquivo de posição em aberto "SecuritiesStatementQueryV02"(bvmf.026.01), com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

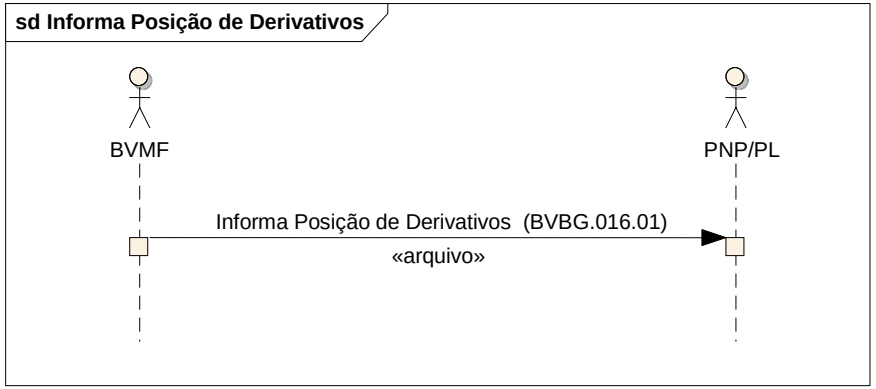
- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Requisita Consulta de Posição- Erro
PNP/PL, MC e Custodiante
BVMF Position
Requisita Consulta de Posição (bvmf.026.01)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01)

Informa detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos

Cenário 1:BVMF informa ao PNP e PL detalhes de negócios realizados no mercado de derivativos

A BVMF informa ao PNP ou PL, ao final do dia, os detalhes de negócios realizados no dia no mercado de derivativos fungíveis através do arquivo de movimentação de posição de derivativos BVBG.016.01-DerivativesPositionMovement.



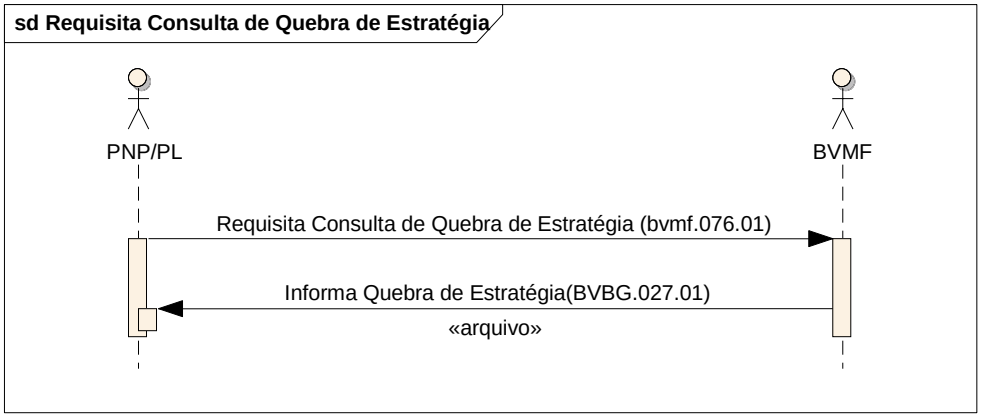
Informa Quebra de Estratégia

Cenário 1: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de quebra de estratégias oriunda de um PNP ou PL.

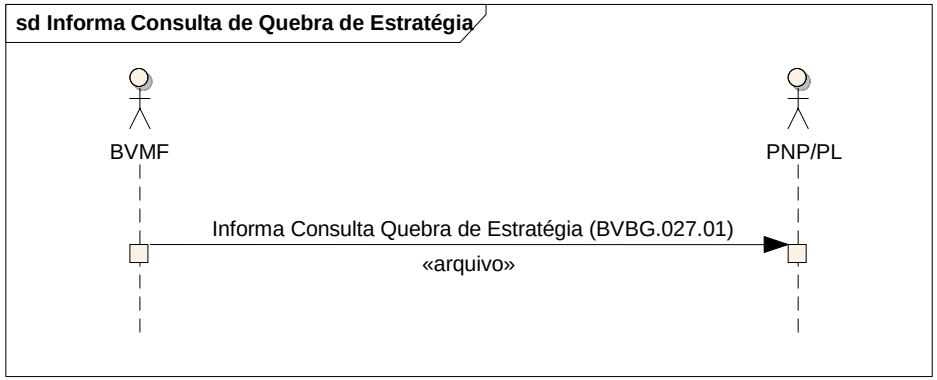
-O Participante envia a mensagem BVMF076.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownRequest”)

- Quando o arquivo é totalmente processado, a BM&FBOVESPA envia o arquivo BVBG.027.01 – Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownResponse”). Se não houver informação para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.



Cenário 2: BM&F Informa resultado de quebra de estratégia

A BVMF informa ao PNP ou PL, ao final do dia, o resultado do processo de quebra dos negócios de estratégia realizado no dia através do arquivo BVBG.027.01 – Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownResponse”).



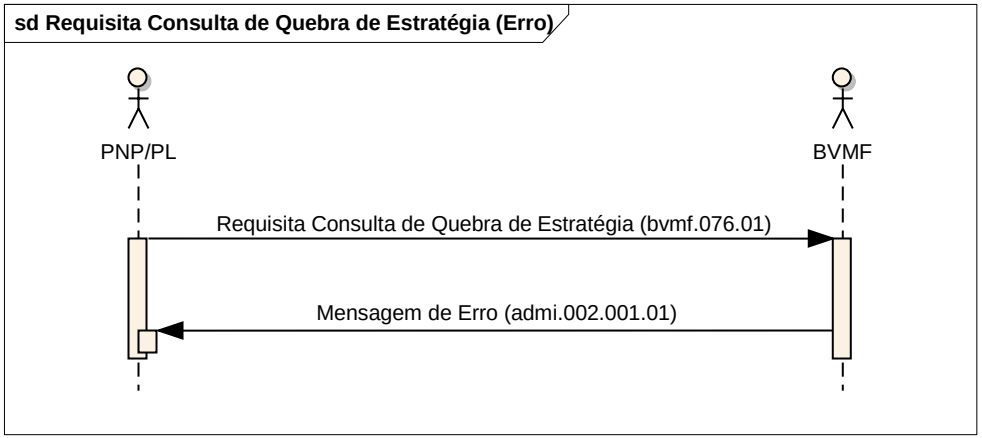
Cenário 3: Participante requisita arquivo de quebra de estratégia

Cenário de Erro

O fluxo abaixo ilustra a requisição do arquivo de quebra de estratégias oriunda de um PNP ou PL.

-O Participante envia a mensagem bvmf.076.01 – Mensagem de Solicitação do Arquivo de Quebra de Estratégia (“StrategyBreakdownRequest”) à BM&FBOVESPA, com alguma não-conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (admi.002.001.01) com o código referente ao motivo da rejeição.

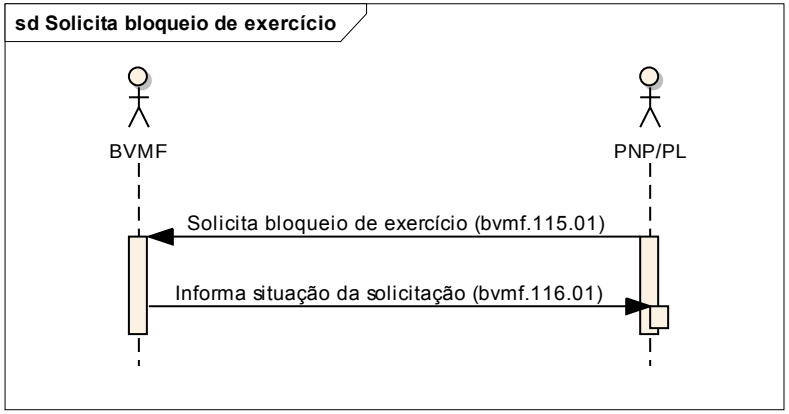

sd Requisita Consulta de Quebra de Estratégia (Erro)
PNP/PL
BVMF
Requisita Consulta de Quebra de Estratégia (bvmf.076.01)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01)

Informa Bloqueio de Exercício

Cenário 1- Participante solicita bloqueio de exercício

-O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.115.01 BlockExerciseInstruction solicitando o bloqueio de exercício à BM&FBOVESPA.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.116.01 BlockExerciseStatusAdvice ao Participante solicitante, informando o status do bloqueio de exercício.

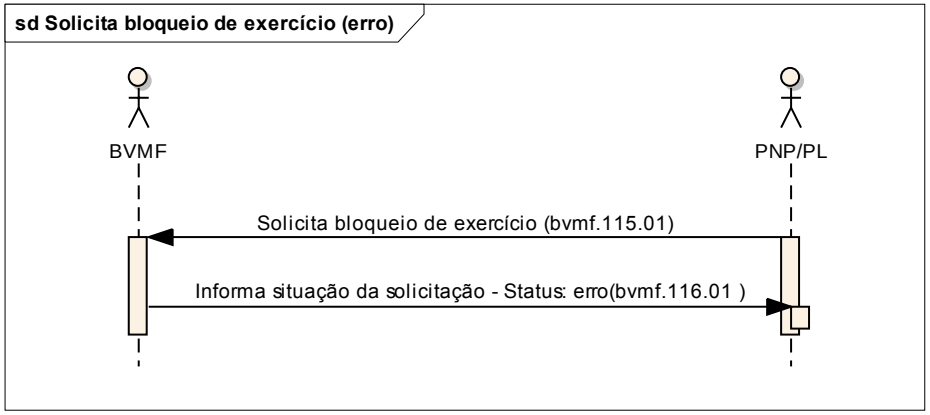


Cenário 2- Participante solicita bloqueio de exercício

Cenário de Erro

-O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.115.01 BlockExerciseInstruction solicitando o bloqueio de exercício à BM&FBOVESPA com alguma não conformidade nos parâmetros utilizados.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.116.01 BlockExerciseStatusAdvice ao Participante solicitante, informando o código do erro referente ao motivo da rejeição do bloqueio de exercício.

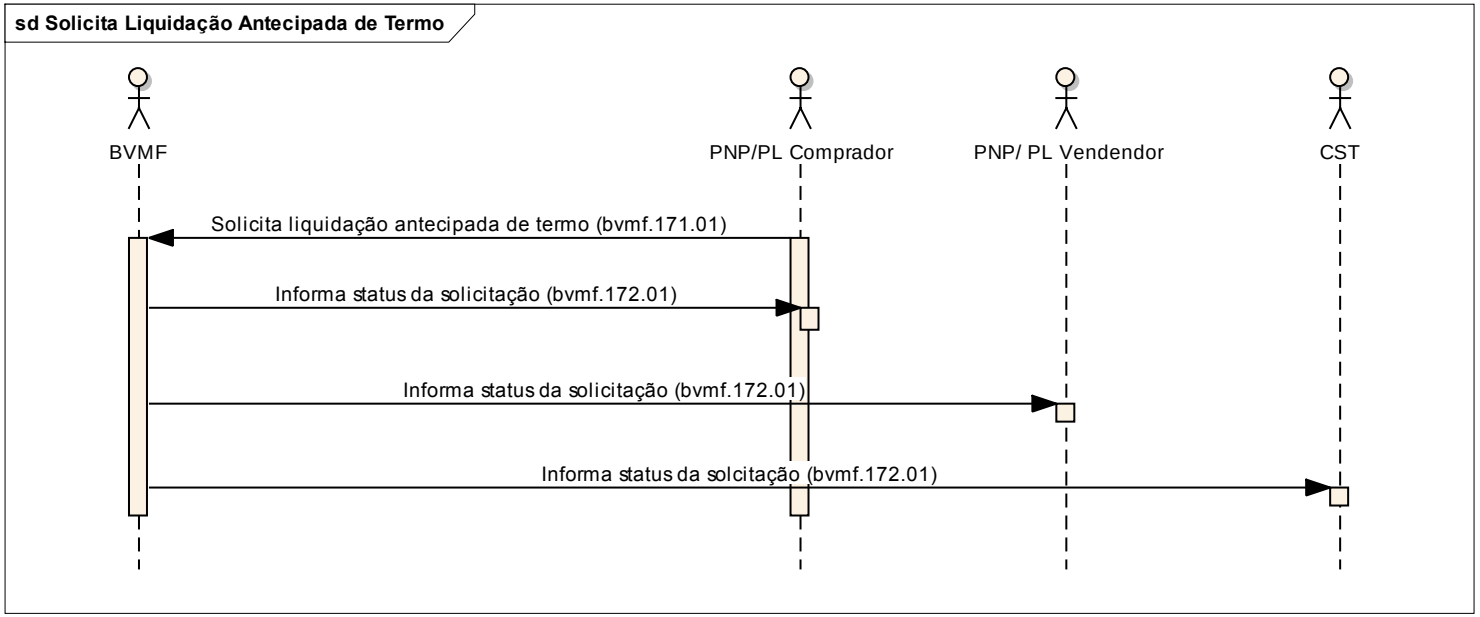

sd Solicita bloqueio de exercício (erro)
BVMF
PNP/PL
Solicita bloqueio de exercício (bvmf.115.01)
Informa situação da solicitação - Status: erro(bvmf.116.01)

Liquidação Antecipada de Termo

Cenário 1- Participante solicita liquidação antecipada de termo

-O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação comprador envia a mensagem bvmf.171. EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest à BM&FBOVESPA solicitando a liquidação antecipada de termo;

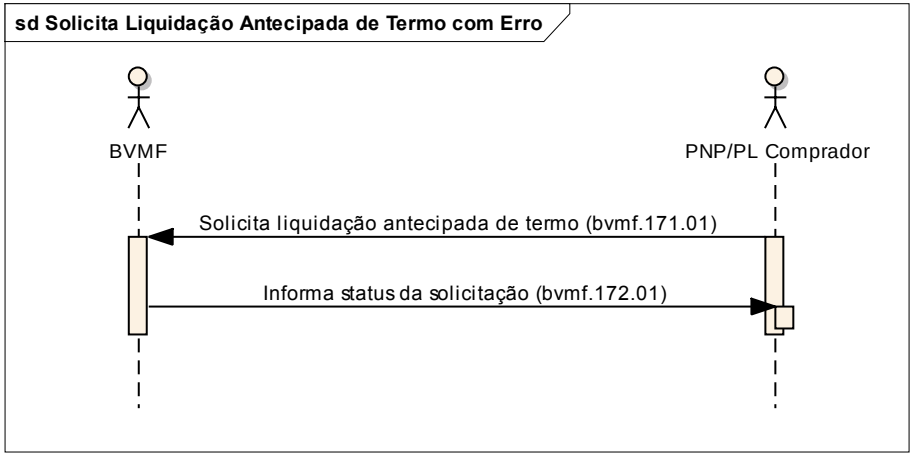
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação (comprador e vendor) e Custodiante (se indicado), informando o status da liquidação da antecipada.



Cenário 2- Participante solicita liquidação antecipada de termo com erro

-O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.171. EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest à BM&FBOVESPA solicitando a liquidação antecipada de termo;

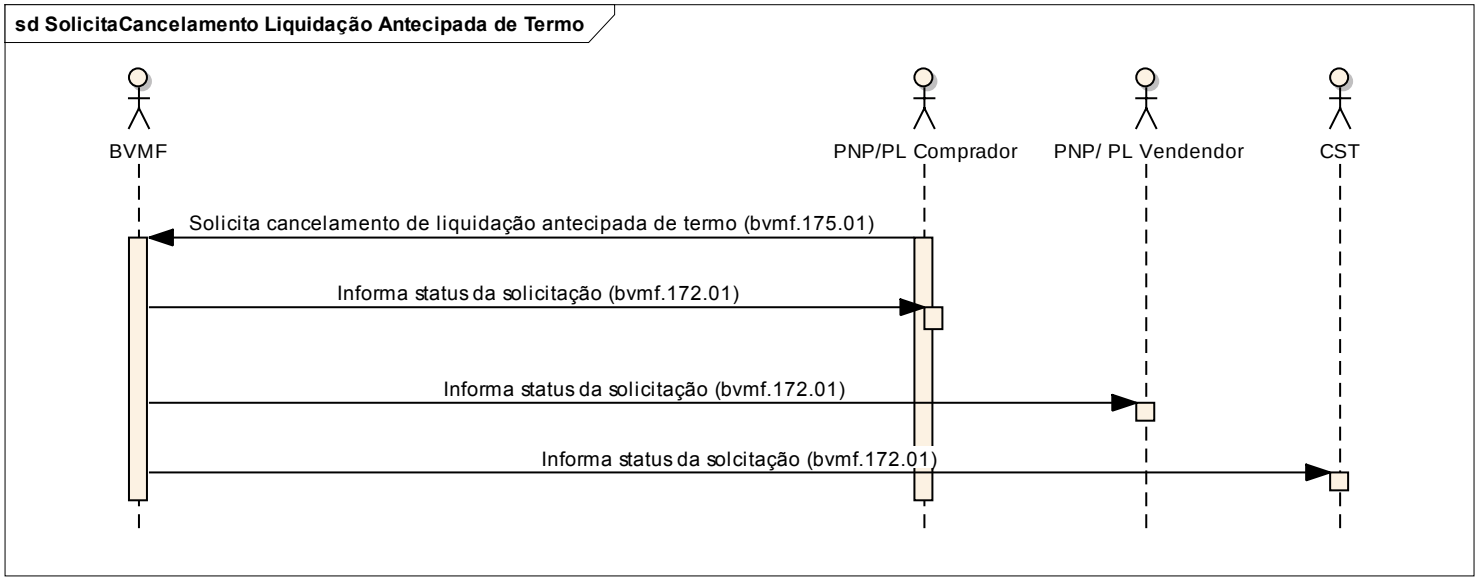
- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.171. EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest, a BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador com o status de erro e o motivo do erro.


sd Solicita Liquidação Antecipada de Termo com Erro
BVMF
PNP/PL Comprador
Solicita liquidação antecipada de termo (bvmf.171.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)

Cenário 3- Participante solicita cancelamento de liquidação antecipada de termo

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.175.01. EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest à BM&FBOVESPA solicitando o cancelamento da liquidação antecipada de termo;

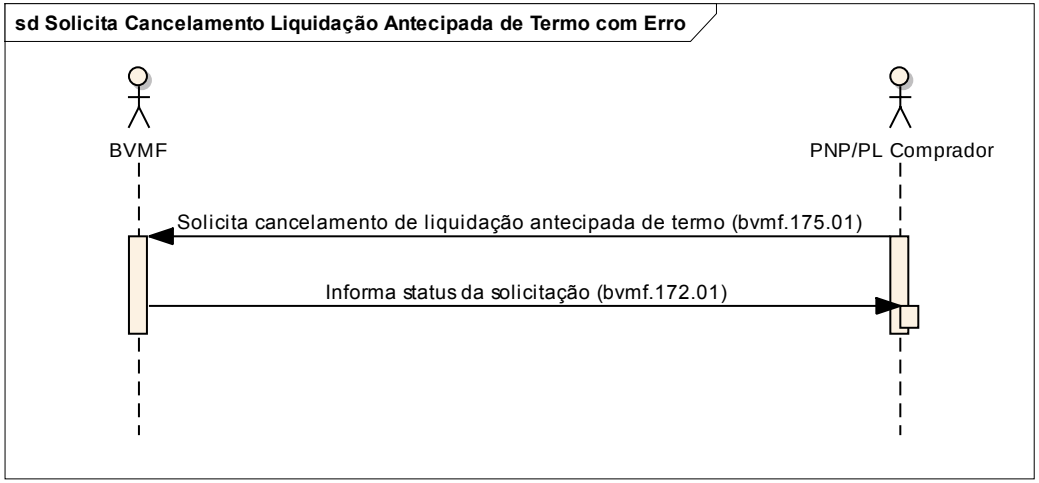
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação (comprador e vendor) e Custodiante (se indicado), informando o status do cancelamento da liquidação da antecipada de termo.


sd SolicitaCancelamento Liquidação Antecipada de Termo
BVMF
PNP/PL Comprador
PNP/ PL Vendendor
CST
Solicita cancelamento de liquidação antecipada de termo (bvmf.175.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solcitação (bvmf.172.01)

Cenário 4- Participante solicita cancelamento de liquidação antecipada de termo com erro

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.175.01. EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest à BM&FBOVESPA solicitando o cancelamento da liquidação antecipada de termo;

- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.175.01. EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest, a BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação, com o status de erro e o motivo do erro.

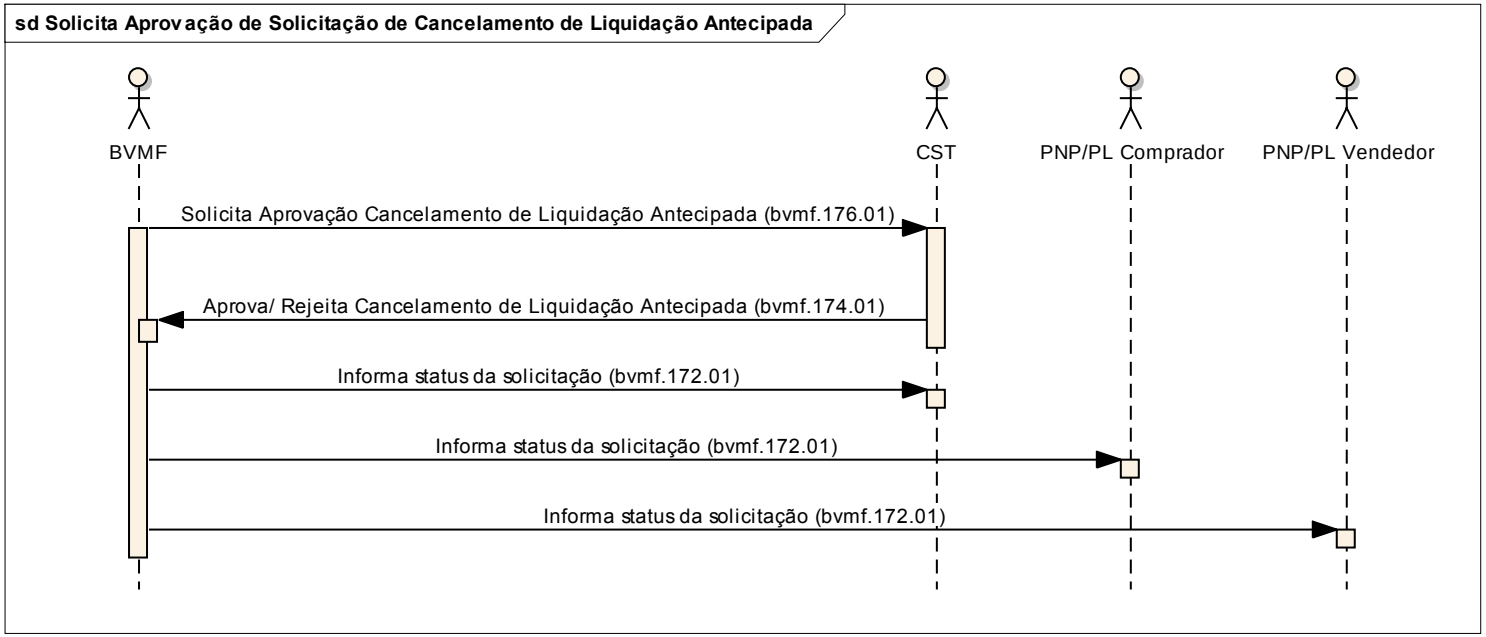

sd Solicita Cancelamento Liquidação Antecipada de Termo com Erro
BVMF
PNP/PL Comprador
Solicita cancelamento de liquidação antecipada de termo (bvmf.175.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)

Cenário 5- Custodiante aprova ou rejeita cancelamento de liquidação antecipada com direcionamento de custodia

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante, a mensagem bvmf.176.01EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest, como requisição de confirmação de cancelamento de liquidação antecipada de termo, quando houver direcionamento de custódia;

- O Custodiante envia à BM&FBOVESPA a mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse com a aprovação ou rejeição da solicitação de cancelamento de liquidação antecipada de termo;

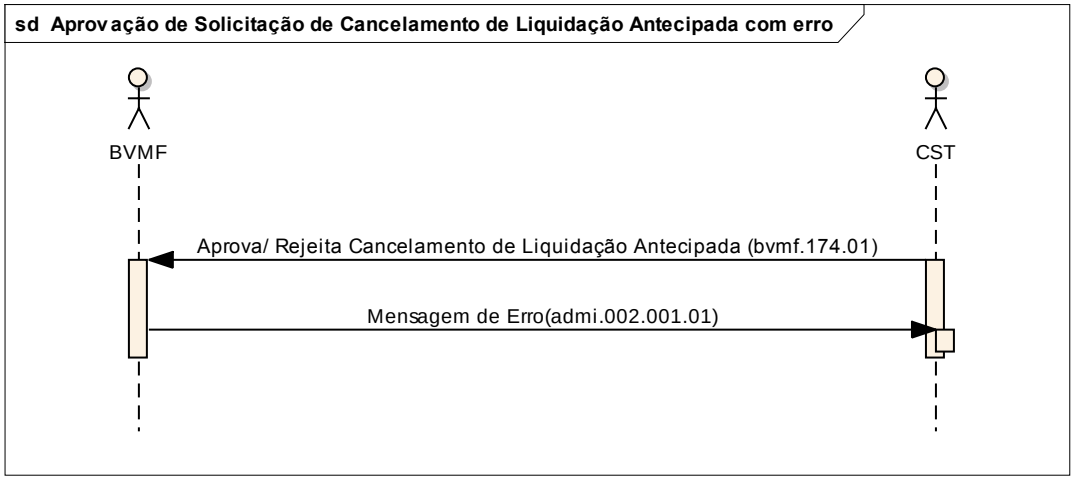
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, aos Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação (comprador e vendor) e Custodiante, informando o status do cancelamento da liquidação da antecipada de termo.


sd Solicita Aprovação de Solicitação de Cancelamento de Liquidação Antecipada
BVMF
CST
PNP/PL Comprador
PNP/PL Vendedor
Solicita Aprovação Cancelamento de Liquidação Antecipada (bvmf.176.01)
Aprova/ Rejeita Cancelamento de Liquidação Antecipada (bvmf.174.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)

Cenário 6- Custodiante aprova ou rejeita cancelamento de liquidação antecipada com direcionamento de custodia com erro

- O Custodiante envia à BM&FBOVESPA a mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse com a aprovação ou rejeição da solicitação de cancelamento de direcionamento de custodiante

- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse, a BM&FBOVESPA envia uma Message Reject (admi.002.001.01) ao Custodiante com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Aprovação de Solicitação de Cancelamento de Liquidação Antecipada com erro
BVMF
CST
Aprova/ Rejeita Cancelamento de Liquidação Antecipada (bvmf.174.01)
Mensagem de Erro(admi.002.001.01)

Direcionamento de Custodiante na Liquidação de Termo

Cenário 1- Participante Solicita Direcionamento de Custodiante na Liquidação de Termo

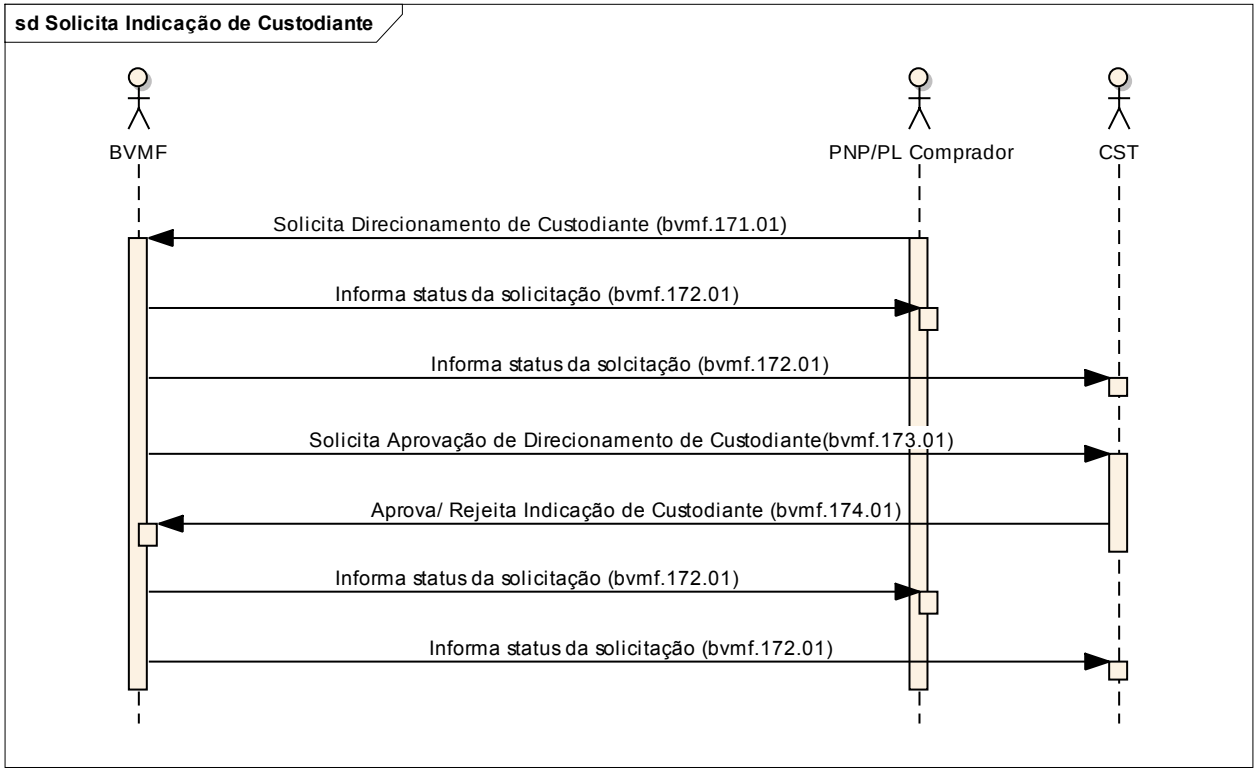
-O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação comprador envia a mensagem bvmf.171. EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest à BM&FBOVESPA solicitando o direcionamento de custodiante na liquidação de termo.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador e Custodiante, informando o status da solicitação de direcionamento de custodiante.

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante, a mensagem bvmf.173.01CustodianIndicationApprovalRequest, como requisição de confirmação de direcionamento de custodiante.

- O Custodiante envia à BM&FBOVESPA a mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse com a aprovação ou rejeição da solicitação de direcionamento de custodiante;

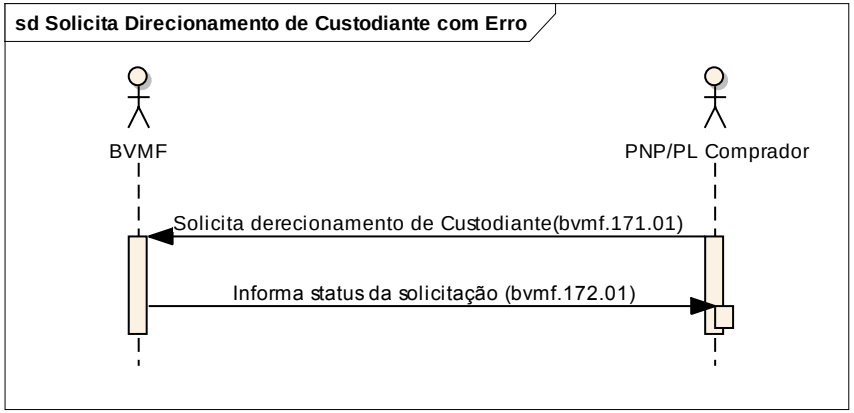
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, aos Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador e Custodiante, informando o status do cancelamento do direcionamento de custodiante.


sd Solicita Indicação de Custodiante
BVMF
PNP/PL Comprador
CST
Solicita Direcionamento de Custodiante (bvmf.171.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solcitação (bvmf.172.01)
Solicita Aprovação de Direcionamento de Custodiante(bvmf.173.01)
Aprova/ Rejeita Indicação de Custodiante (bvmf.174.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)

Cenário 2- Participante Solicita Direcionamento de Custodiante na Liquidação de Termo com Erro

-O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.171. EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest à BM&FBOVESPA solicitando o direcionamento de Custodiante.

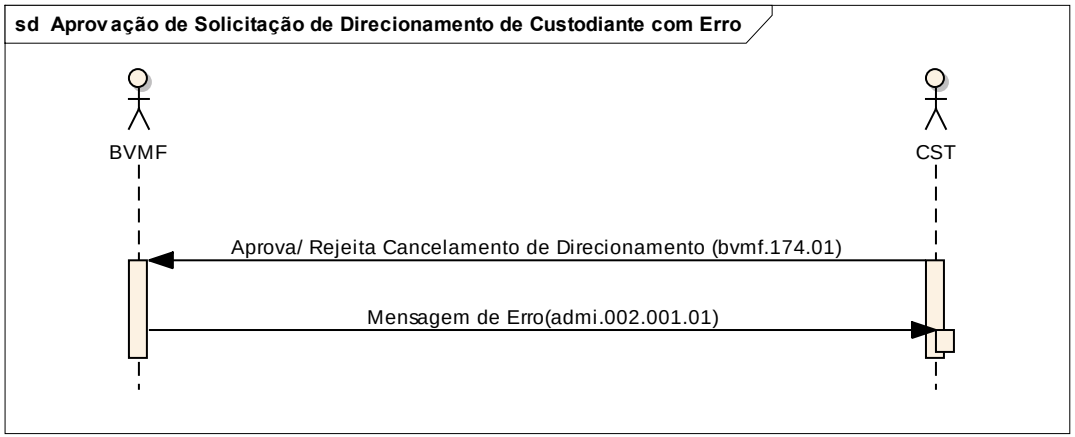
- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.171. EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest, a BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 com o status de erro e o motivo do erro.EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador



Cenário 3- Custodiante aprova ou rejeita direcionamento de custodiante com erro

- O Custodiante envia à BM&FBOVESPA a mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse com a aprovação ou rejeição da solicitação de direcionamento de custodiante

- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse, a BM&FBOVESPA envia uma Message Reject (admi.002.001.01) ao Custodiante com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Aprovação de Solicitação de Direcionamento de Custodiante com Erro
BVMF
CST
Aprova/ Rejeita Cancelamento de Direcionamento (bvmf.174.01)
Mensagem de Erro(admi.002.001.01)

Cenário 4- Participante solicita cancelamento de direcionamento de custodia

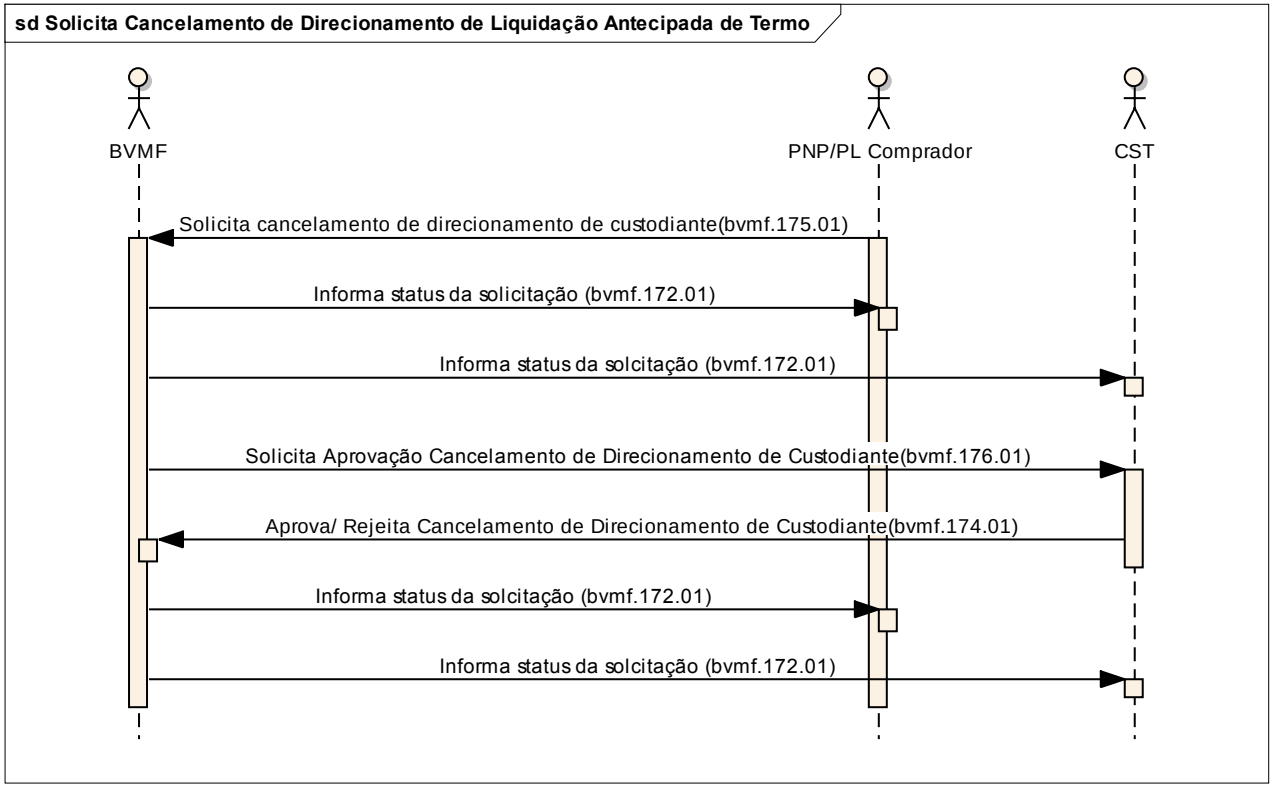
- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.175.01. EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest à BM&FBOVESPA solicitando o cancelamento de direcionamento da liquidação de termo.

- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador e Custodiante, informando o status do cancelamento do direcionamento de custodiante da liquidação ode termo.

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante, a mensagem bvmf.176.01EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest, como requisição de confirmação de cancelamento de direcionamento de custodiante da liquidação de termo.

- O Custodiante envia à BM&FBOVESPA a mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse com a aprovação ou rejeição da solicitação de cancelamento do direcionamento de liquidação de termo.

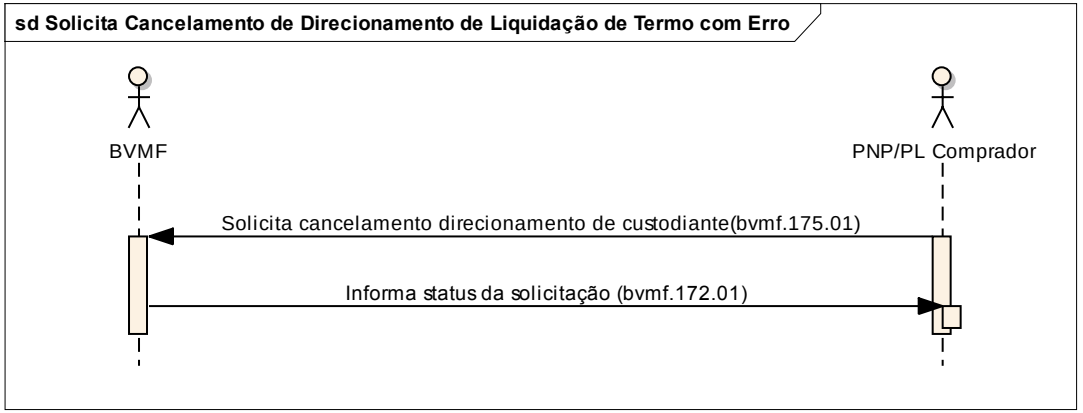
- A BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador e Custodiante, informando o status do cancelamento do direcionamento de liquidação de termo.


sd Solicita Cancelamento de Direcionamento de Liquidação Antecipada de Termo
BVMF
PNP/PL Comprador
CST
Solicita cancelamento de direcionamento de custodiante(bvmf.175.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)
Informa status da solcitação (bvmf.172.01)
Solicita Aprovação Cancelamento de Direcionamento de Custodiante(bvmf.176.01)
Aprova/ Rejeita Cancelamento de Direcionamento de Custodiante(bvmf.174.01)
Informa status da solcitação (bvmf.172.01)
Informa status da solcitação (bvmf.172.01)

Cenário 5- Participante solicita cancelamento de direcionamento de custodiante com erro

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação envia a mensagem bvmf.175.01. EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest à BM&FBOVESPA solicitando o cancelamento do direcionamento de liquidação de termo.

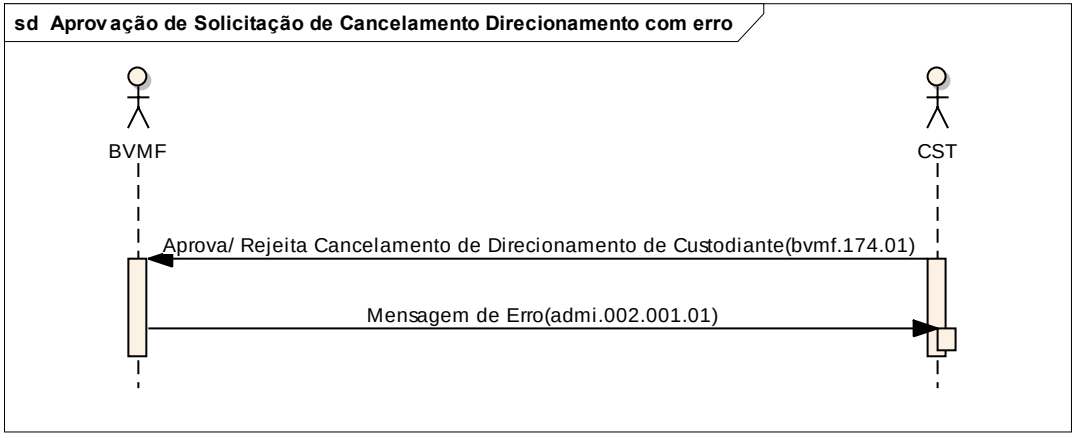
- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.175.01. EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest, a BM&FBOVESPA envia a mensagem bvmf.172.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice, ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação comprador, com o status de erro e o motivo do erro.


sd Solicita Cancelamento de Direcionamento de Liquidação de Termo com Erro
BVMF
PNP/PL Comprador
Solicita cancelamento direcionamento de custodiante(bvmf.175.01)
Informa status da solicitação (bvmf.172.01)

Cenário6- Custodiante aprova ou rejeita cancelamento de direcionamento de custodia com erro

- O Custodiante envia à BM&FBOVESPA a mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse com a aprovação ou rejeição da solicitação de cancelamento de direcionamento de custodiante

- Se houver informação inválida na mensagem bvmf.174.01 EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse, a BM&FBOVESPA envia uma Message Reject (admi.002.001.01) ao Custodiante com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Aprovação de Solicitação de Cancelamento Direcionamento com erro
BVMF
CST
Aprova/ Rejeita Cancelamento de Direcionamento de Custodiante(bvmf.174.01)
Mensagem de Erro(admi.002.001.01)

Fluxos de Transferência de Posição

Os fluxos de transferência de posição estão contemplados no Anexo I.

Solicitação de alteração de atributos do Contrato de Aluguel de Ativos em aberto

Cenário 1- Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Solicita Alteração de Contrato de Aluguel de Ativos com Sucesso

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractModificationInstruction <bvmf.129.01>**, solicitando alteração de atributos no contrato de aluguel de ativos que impactam o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Contrapartre;

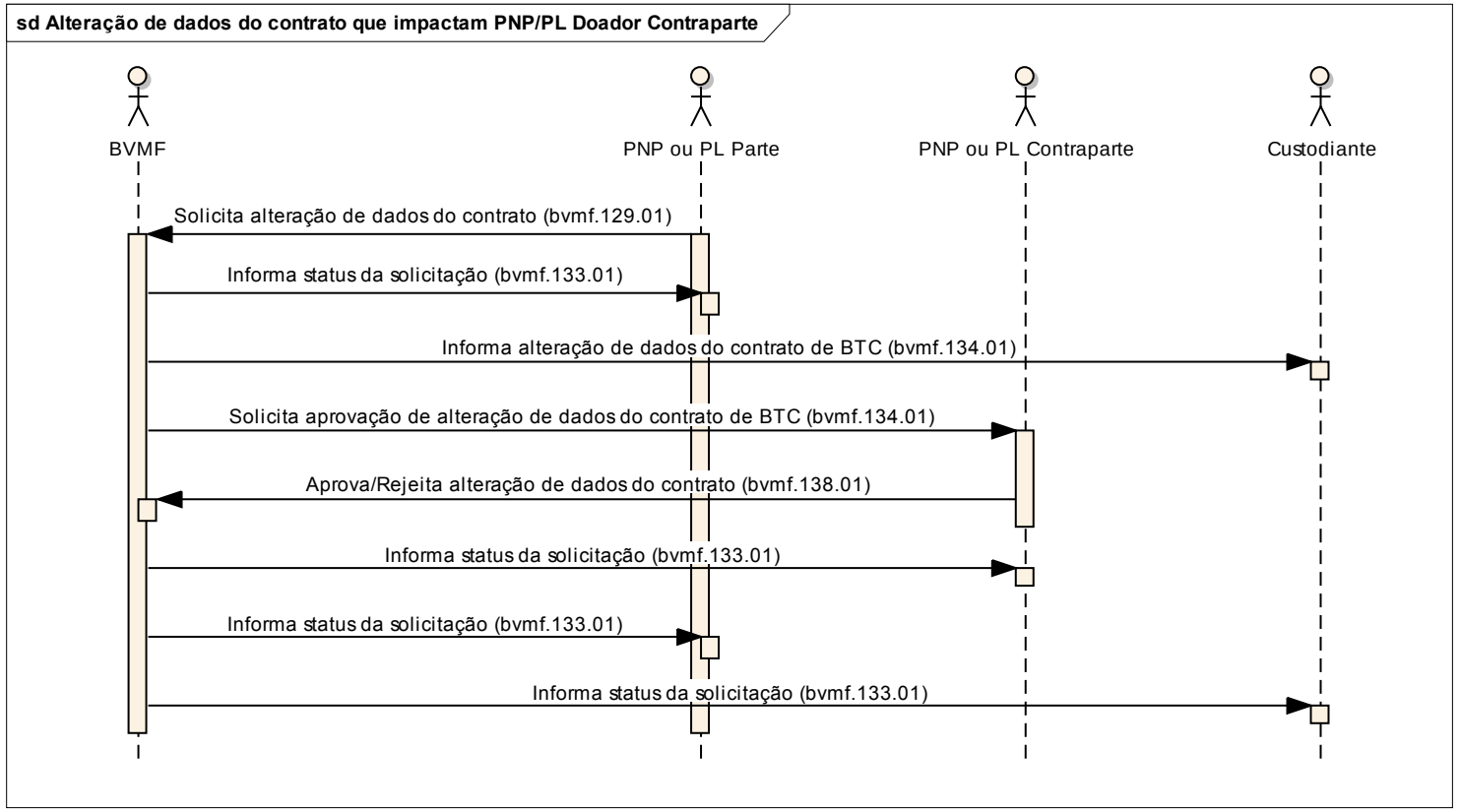
- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da alteração do contrato;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Contraparte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractModificationAdvice <bvmf.134.01>**, como requisição para aprovação da alteração de contrato de aluguel de ativos.

- A BM&FBOVESPA envia aos Custodiantes, a mensagem **ContractModificationAdvice <bvmf.134.01>**, como informe de alteração de contrato de aluguel de ativos por parte do Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Contraparte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da alteração do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participantes, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da alteração do contrato;

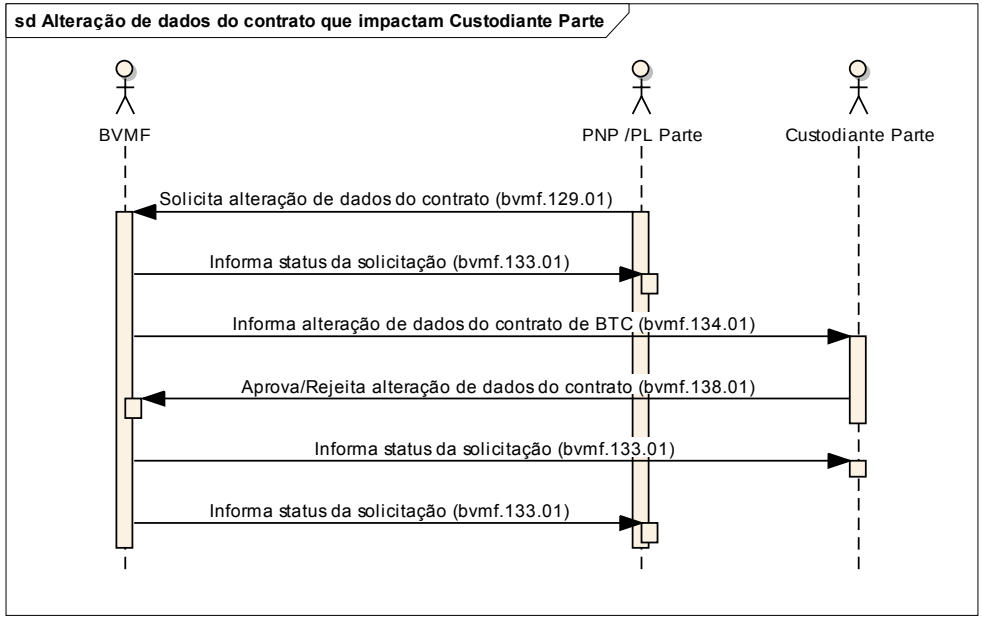

sd Alteração de dados do contrato que impactam PNP/PL Doador Contraparte
BVMF
PNP ou PL Parte
PNP ou PL Contraparte
Custodiante
Solicita alteração de dados do contrato (bvmf.129.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa alteração de dados do contrato de BTC (bvmf.134.01)
Solicita aprovação de alteração de dados do contrato de BTC (bvmf.134.01)
Aprova/Rejeita alteração de dados do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 2- Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Solicita Alteração dados de Custodiantes no Contrato de Aluguel De Ativos com Sucesso

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractModificationInstruction < bvmf.129.01>**, solicitando alteração dos atributos de conta de custódia ou carteira no mesmo custodiante.

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante, a mensagem **ContractModificationAdvice <bvmf.134.01>**, como informe de alteração de contrato de aluguel de ativos por parte do Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte.

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos e Custodiante Parte, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da alteração do contrato;


sd Alteração de dados do contrato que impactam Custodiante Parte
BVMF
PNP /PL Parte
Custodiante Parte
Solicita alteração de dados do contrato (bvmf.129.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa alteração de dados do contrato de BTC (bvmf.134.01)
Aprova/Rejeita alteração de dados do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 3- Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Solicita Alteração de Custodiante com Sucesso

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractModificationInstruction < bvmf.129.01>**, solicitando alteração de Custodiante do contrato de aluguel de ativos;

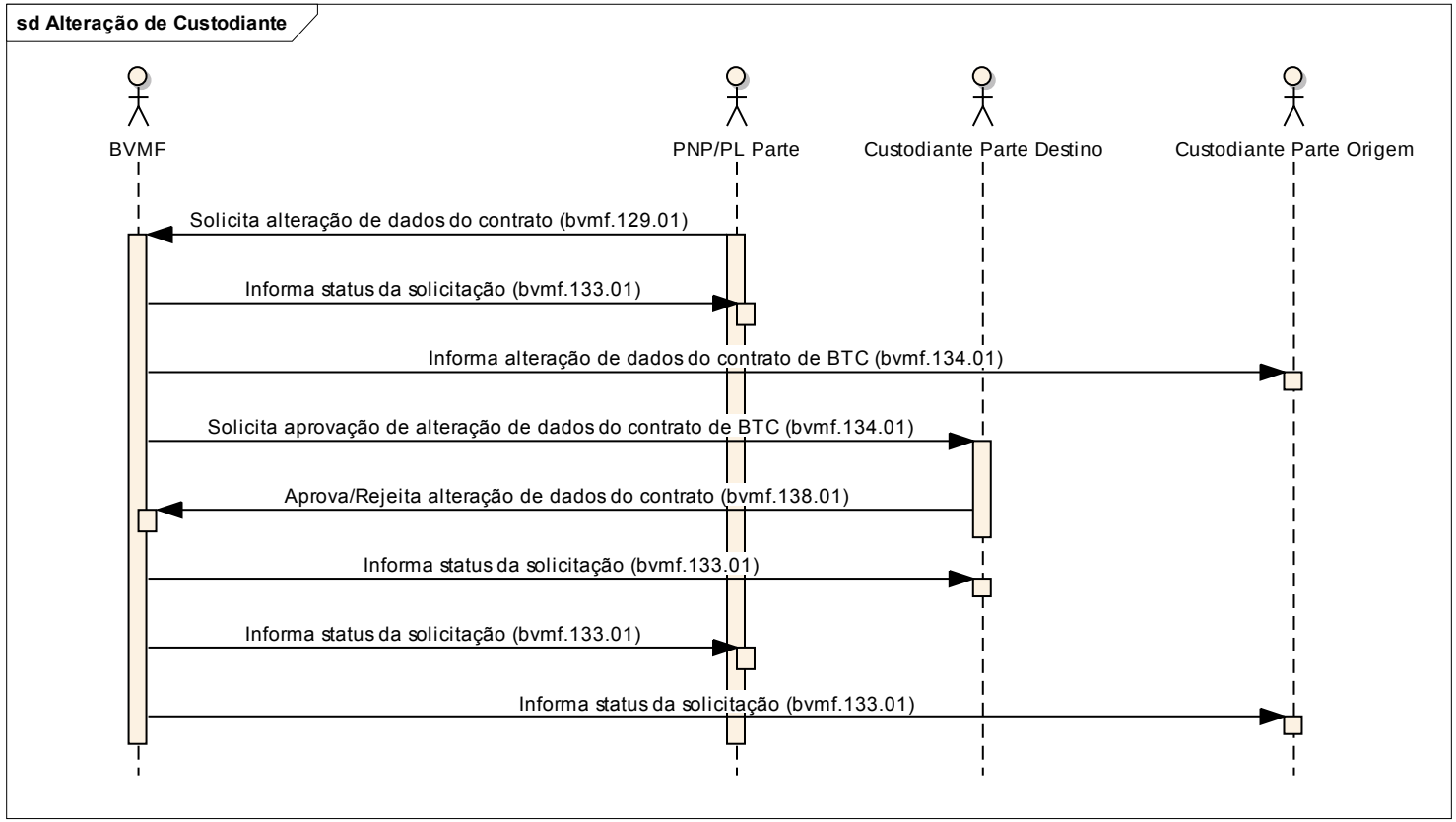
- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da alteração do Custodiante do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante Origem, a mensagem **ContractModificationAdvice <bvmf.134.01>**, como informe de alteração de contrato de aluguel de ativos por parte do Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor das posições do contrato de aluguel de ativos.

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante Destino, a mensagem **ContractModificationAdvice <bvmf.134.01>**, como requisição de confirmação da alteração de Custodiante.

- O Custodiante Destino envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da alteração de Custodiante do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Parte ou Participante de Liquidação e Custodiantes, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da alteração do Custodiante do contrato de aluguel de ativos;

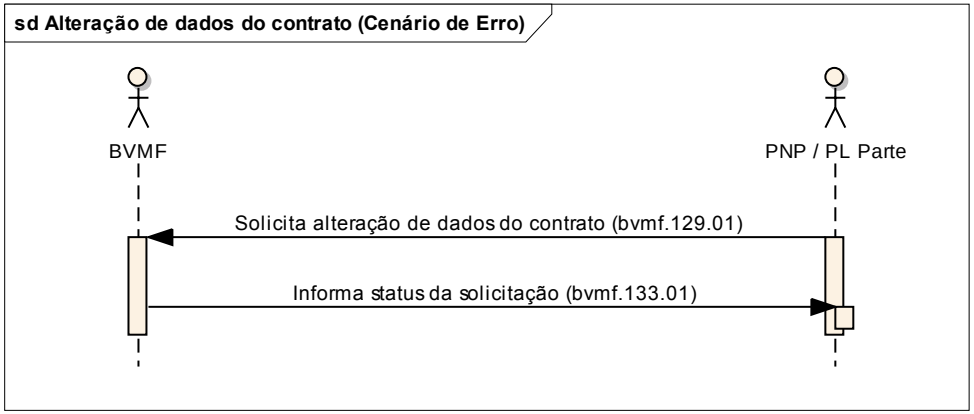

sd Alteração de Custodiante
BVMF
PNP/PL Parte
Custodiante Parte Destino
Custodiante Parte Origem
Solicita alteração de dados do contrato (bvmf.129.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa alteração de dados do contrato de BTC (bvmf.134.01)
Solicita aprovação de alteração de dados do contrato de BTC (bvmf.134.01)
Aprova/Rejeita alteração de dados do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 4- Solicitação de Alteração de Contrato Aluguel De Ativos (dados de Custodiantes ou não) com Erro

Este cenário é utilizado para o participante solicitar a alteração de dados dos contratos de empréstimo de ativos em aberto (Aluguel de Ativos).

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor de posição de contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractModificationInstruction <bvmf.129.01>**, solicitando alteração de atributos no contrato de aluguel de ativos que impactam o Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Contraparte;

- Se houver informação inválida na mensagem **ContractModificationInstruction <bvmf.129.01>**, a BM&FBOVESPA envia a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>** ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos com o status de erro e o motivo do erro.

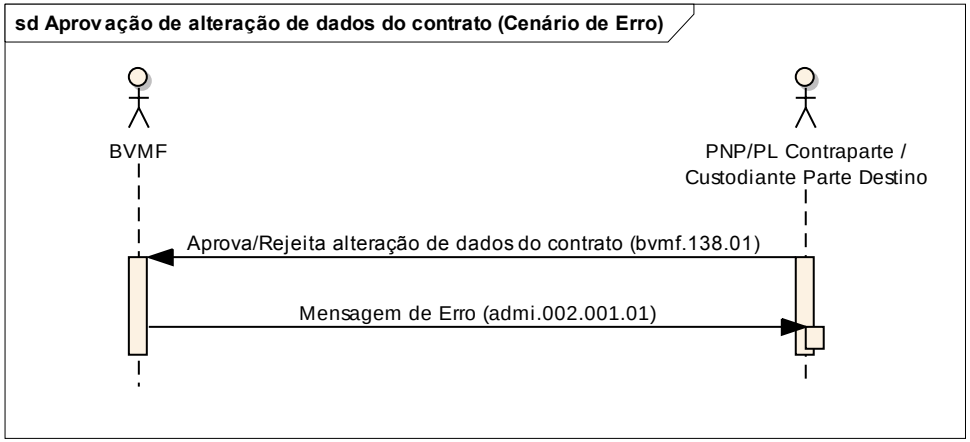

sd Alteração de dados do contrato (Cenário de Erro)
BVMF
PNP / PL Parte
Solicita alteração de dados do contrato (bvmf.129.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário5- Aprovação de Alteração de Contrato Aluguel de Ativos (dados de Custodiantes ou não) com Erro

Este cenário é utilizado para o participante aprovar a alteração de dados dos contratos de aluguel de ativos em aberto.

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Contraparte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos ou Custodiante Destino envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da alteração de Custodiante do contrato de aluguel de ativos;

- Se houver informação inválida na mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, a BM&FBOVESPA envia uma **mensagem de erro (admi.002.001.01)** ao Participante de Liquidação Pleno/Participante de Liquidação Contraparte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos ou Custodiante Parte Destino com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Aprovação de alteração de dados do contrato (Cenário de Erro)
BVMF
PNP/PL Contraparte / Custodiante Parte Destino
Aprova/Rejeita alteração de dados do contrato (bvmf.138.01)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01)

Solicitação de renovação do Contrato de Aluguel de Ativos em aberto

Cenário 1- Renovação de Aluguel de Ativos pelo Doador com sucesso

- O Participante de Negociação Pleno Doador ou Participante de Liquidação Doador da oferta do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractRenewalInstruction <bvmf.130.01>**, solicitando renovação do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador, Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da renovação do contrato;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractRenewalApprovalRequest <bvmf.135.01>** como requisição de confirmação da renovação do contrato de aluguel de ativos;

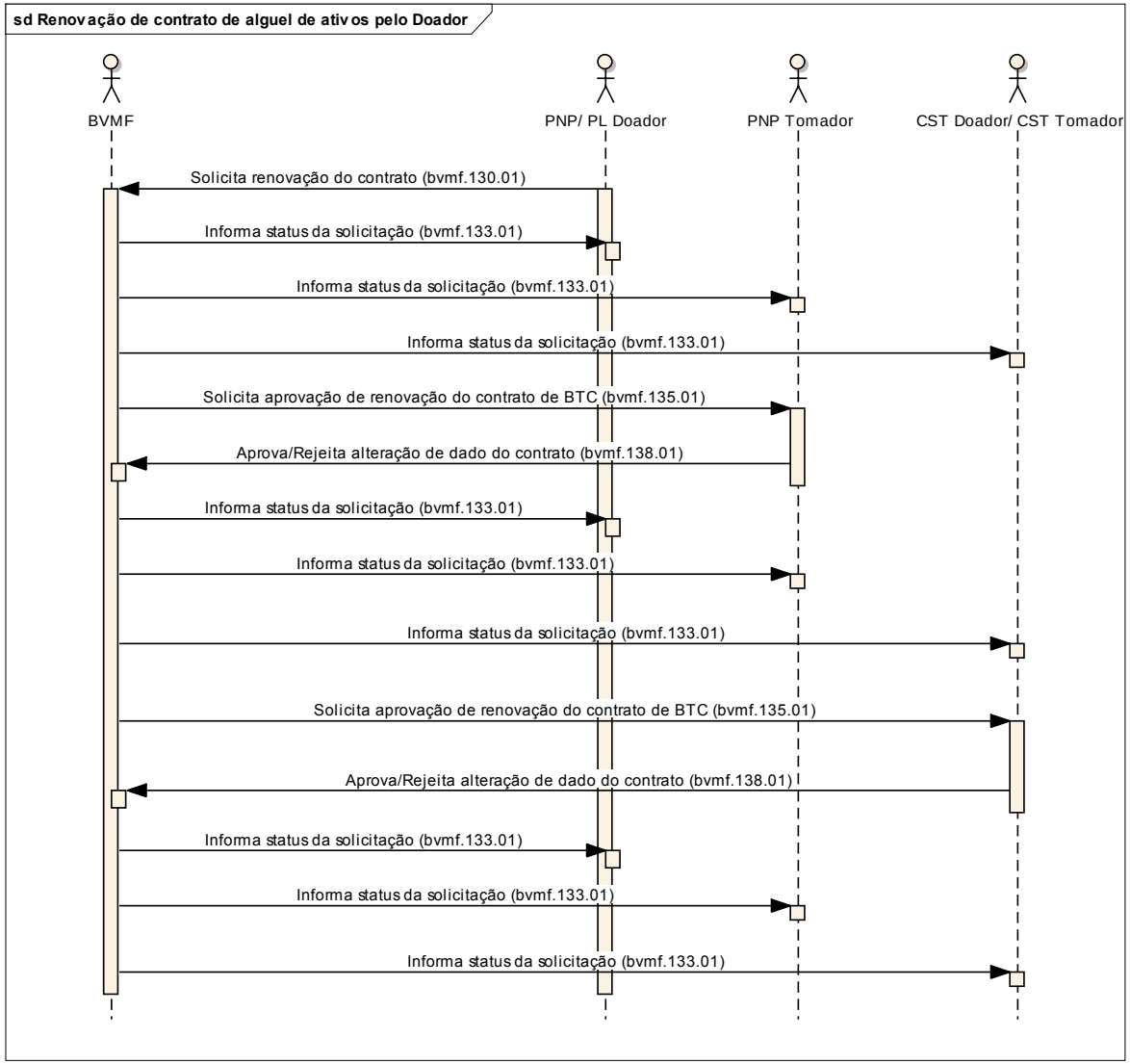
- O Participante de Negociação Pleno Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador, Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da renovação do contrato;

- A BM&FBOVESPA envia aos Custodiantes Doador e Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractRenewalApprovalRequest <bvmf.135.01>** como requisição de confirmação da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- Os Custodiantes Doador e Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador, Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da renovação do contrato.


sd Renovação de contrato de aluguel de ativos pelo Doador
BVMF
PNP/ PL Doador
PNP Tomador
CST Doador/ CST Tomador
Solicita renovação do contrato (bvmf.130.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Solicita aprovação de renovação do contrato de BTC (bvmf.135.01)
Aprova/Rejeita alteração de dado do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Solicita aprovação de renovação do contrato de BTC (bvmf.135.01)
Aprova/Rejeita alteração de dado do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 2- Renovação de Aluguel de Ativos pelo Tomador com sucesso

- O Participante de Negociação Pleno Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractRenewalInstruction <bvmf.130.01>**, solicitando renovação do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador, Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da renovação do contrato;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador ou Participante de Liquidação Doador da oferta do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractRenewalApprovalRequest <bvmf.135.01>** como requisição de confirmação da renovação do contrato de aluguel de ativos;

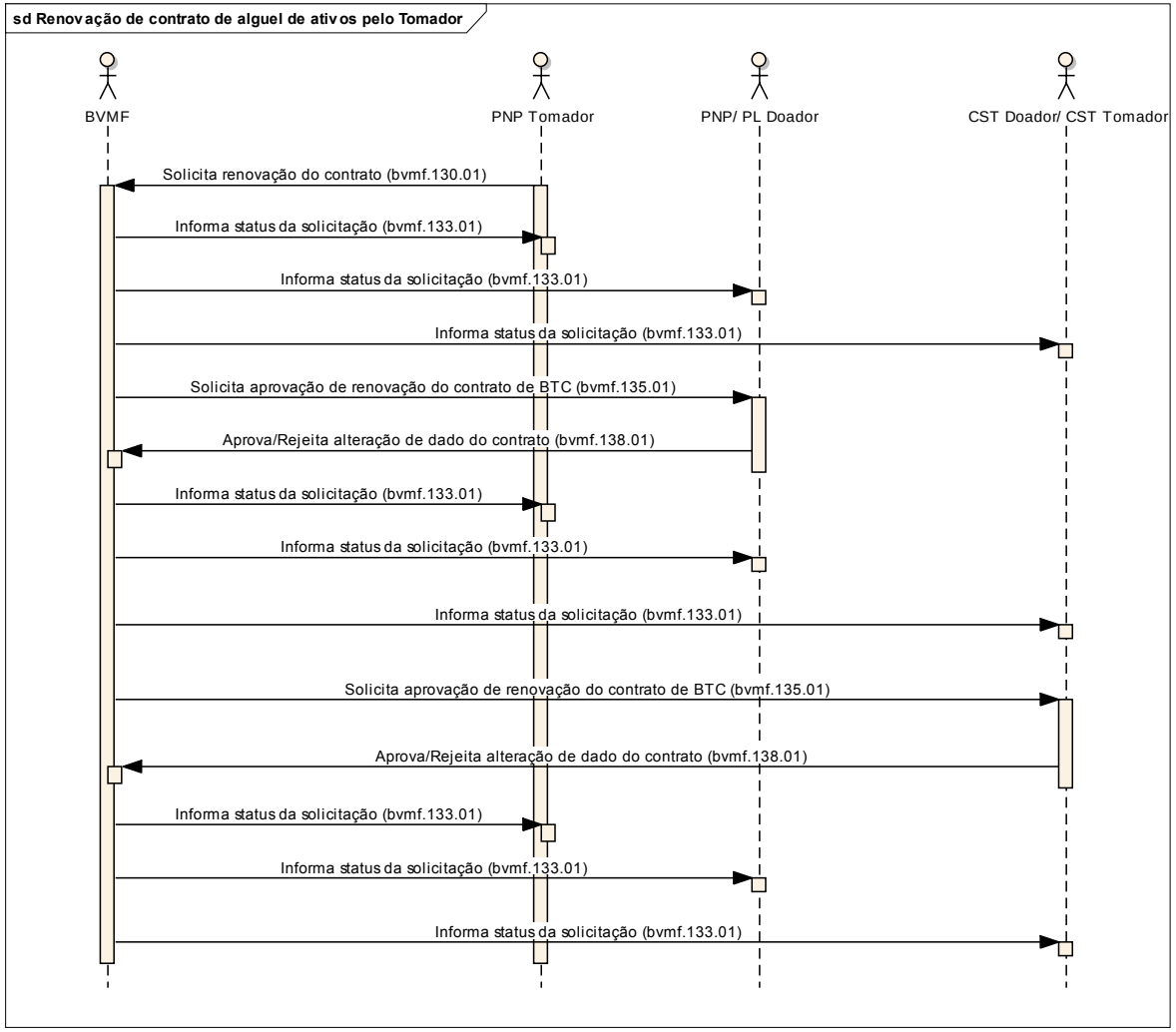
- O Participante de Negociação Pleno Doador ou Participante de Liquidação Doador do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador, Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da renovação do contrato;

- A BM&FBOVESPA envia aos Custodiantes Doador e Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractRenewalApprovalRequest <bvmf.135.01>** como requisição de confirmação da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- Os Custodiantes Doador e Tomador da oferta do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno Doador, Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da renovação do contrato.

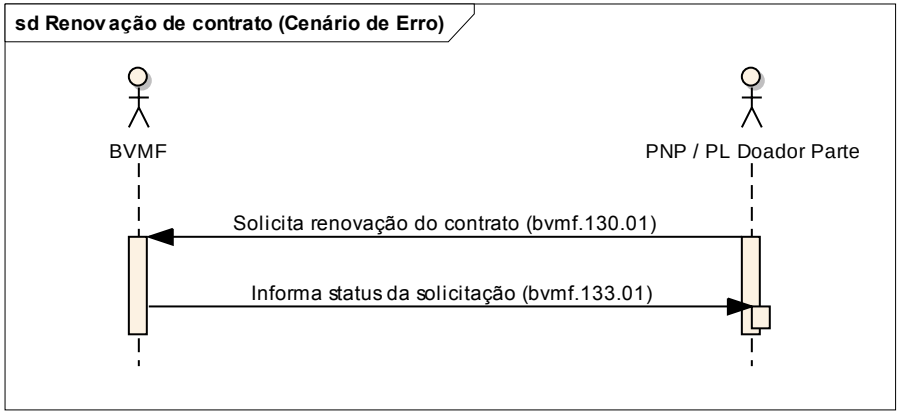

sd Renovação de contrato de aluguel de ativos pelo Tomador
BVMF
PNP Tomador
PNP/ PL Doador
CST Doador/ CST Tomador
Solicita renovação do contrato (bvmf.130.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Solicita aprovação de renovação do contrato de BTC (bvmf.135.01)
Aprova/Rejeita alteração de dado do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Solicita aprovação de renovação do contrato de BTC (bvmf.135.01)
Aprova/Rejeita alteração de dado do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 3- Solicitação de Renovação de Contrato Aluguel de Ativos com Erro

Este cenário é utilizado para o participante solicitar a renovação de contratos de aluguel de ativos em aberto .

- O Participante de Negociação Pleno Contraparte Parte executor da oferta do contrato de aluguel de ativos ou Participante de Liquidação Doador envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractRenewalInstruction <bvmf.130.01>**, solicitando renovação do contrato de aluguel de ativos;

- Se houver informação inválida na mensagem **ContractRenewalInstruction <bvmf.130.01>**, a BM&FBOVESPA envia a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, ao Participante de Liquidação Pleno Parte executor da oferta do contrato de aluguel de ativos ou Participante de Liquidação Doador com o status de erro e o motivo do erro.

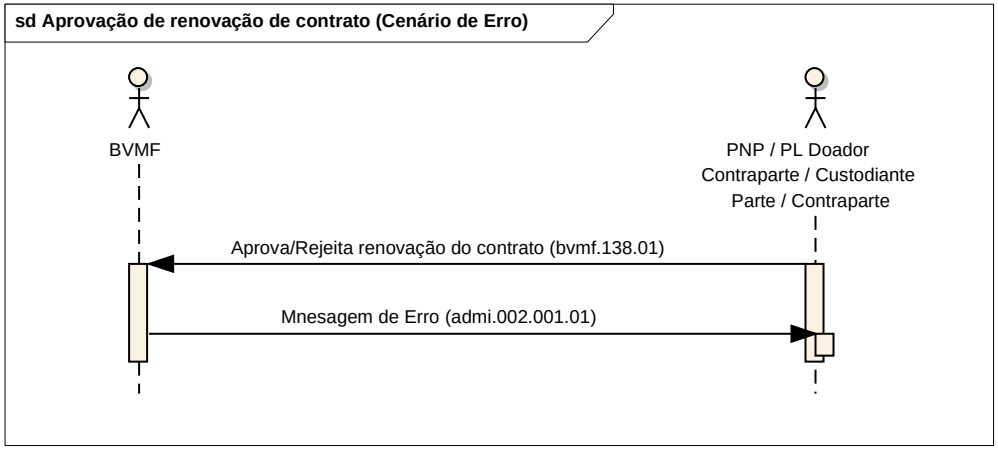

sd Renovação de contrato (Cenário de Erro)
BVMF
PNP / PL Doador Parte
Solicita renovação do contrato (bvmf.130.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 4- Aprovação de Renovação de Contrato Aluguel de Ativos com Erro

Este cenário é utilizado para o participante aprovar a renovação dos contratos de aluguel de ativos em aberto .

- O Participante de Negociação Pleno Contraparte executor da oferta do contrato de aluguel de ativos ou Participante de Liquidação Doador Contraparte e Custodiantes enviam à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da renovação do contrato de aluguel de ativos;

- Se houver informação inválida na mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, a BM&FBOVESPA envia uma **mensagem de erro (admi.002.001.01)** ao Participante de Negociação Pleno Contraparte executor da oferta do contrato de aluguel de ativos, Participante de Liquidação Doador Contraparte ou Custodiante com o código referente ao motivo da rejeição.


sd Aprovação de renovação de contrato (Cenário de Erro)
BVMF
PNP / PL Doador
Contraparte / Custodiante
Parte / Contraparte
Aprova/Rejeita renovação do contrato (bvmf.138.01)
Mnesagem de Erro (admi.002.001.01)

Solicitação de Liquidação Antecipada do Contrato de Aluguel de Ativos em aberto

Cenário 1- Participante de Negociação Pleno Tomador ou Participante de Liquidação Destino Tomador Solicita Liquidação Antecipada de Contrato de Aluguel de Ativos com Sucesso

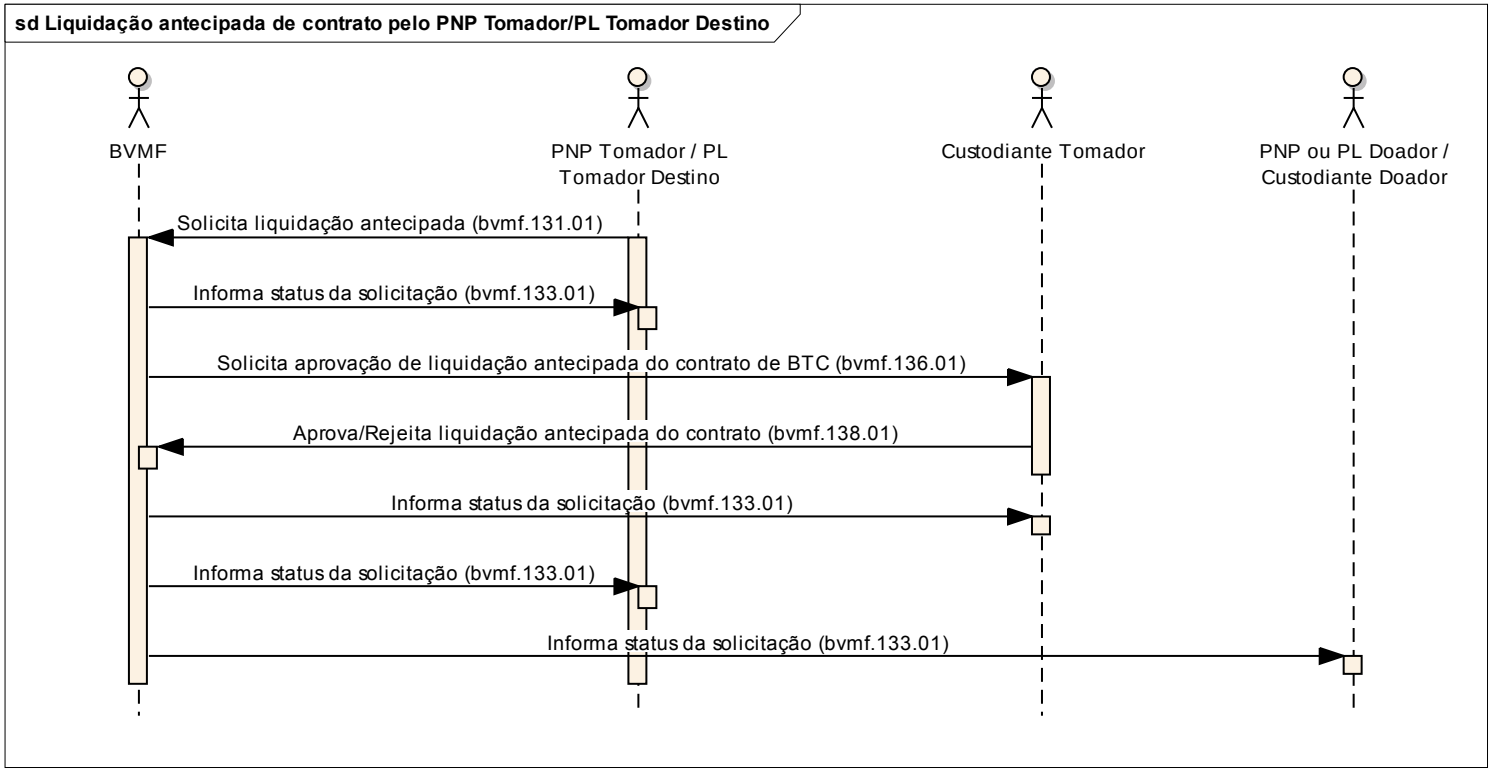
- O Participante de Negociação Pleno Tomador/Participante de Liquidação Destino Tomador detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractEarlySettlementInstruction <bvmf.131.01>**, solicitando liquidação antecipada do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Destino Tomador detentor das posições do contrato de aluguel de ativos, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da liquidação antecipada do contrato;

- A BM&FBOVESPA envia ao Custodiante Tomador, a mensagem **ContractEarlySettlementApprovalRequest < bvmf.136.01>**, solicitando a aprovação da liquidação antecipada do contrato;

- O Custodiante Tomador envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da liquidação antecipada do contrato de Aluguel de Ativos;

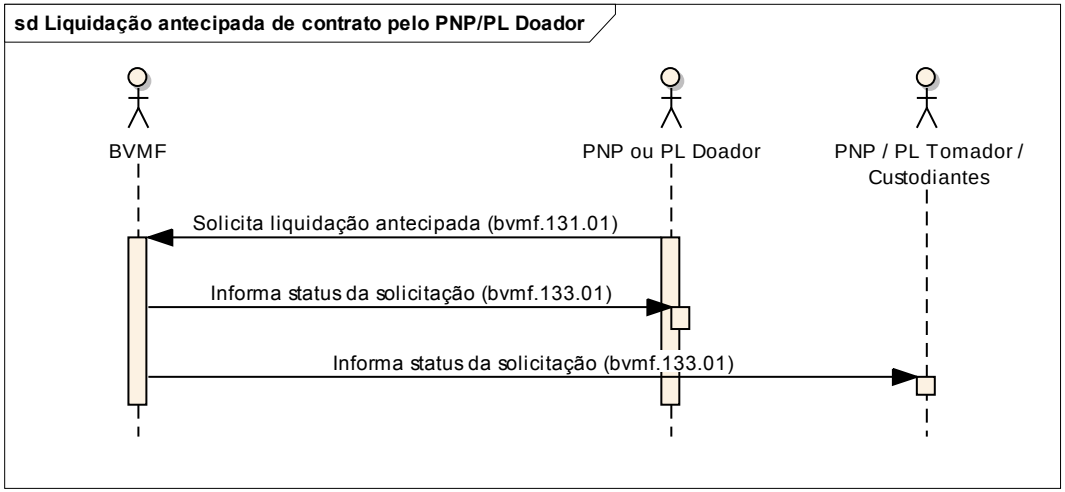
- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação Parte/Contraparte detentor das posições do contrato de aluguel de ativos e Custodiantes a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da liquidação antecipada do contrato;


sd Liquidação antecipada de contrato pelo PNP Tomador/PL Tomador Destino
BVMF
PNP Tomador / PL Tomador Destino
Custodiante Tomador
PNP ou PL Doador / Custodiante Doador
Solicita liquidação antecipada (bvmf.131.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Solicita aprovação de liquidação antecipada do contrato de BTC (bvmf.136.01)
Aprova/Rejeita liquidação antecipada do contrato (bvmf.138.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 2- Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Doador Solicita Liquidação Antecipada de Contrato de Aluguel de Ativos com Sucesso

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Doador detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractEarlySettlementInstruction < bvmf.131.01>**, solicitando liquidação antecipada do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia aos Participantes de Negociação Pleno, Participante de Liquidação detentor das posições do contrato de aluguel de ativos e Custodiantes, a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da liquidação antecipada do contrato;

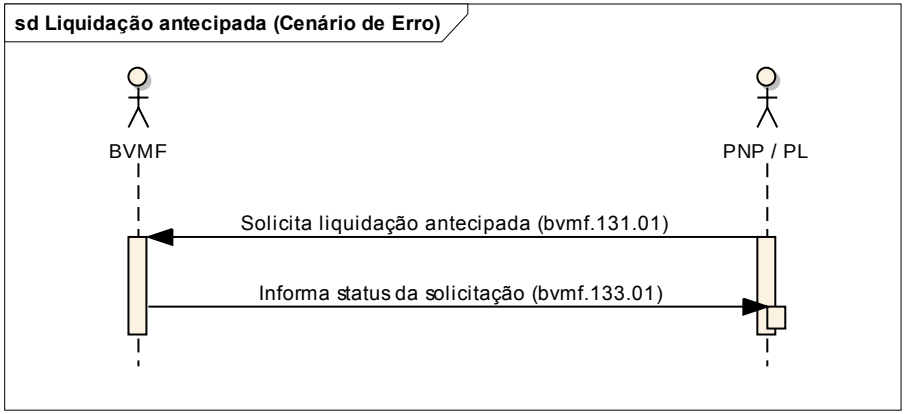

sd Liquidação antecipada de contrato pelo PNP/PL Doador
BVMF
PNP ou PL Doador
PNP / PL Tomador / Custodiantes
Solicita liquidação antecipada (bvmf.131.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 3- Solicitação de Liquidação Antecipada de Contrato Aluguel de Ativos com Erro

Este cenário é utilizado para o participante solicitar a liquidação antecipada de contratos de aluguel de ativos em aberto .

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor das posições do contrato de aluguel de ativos envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractEarlySettlementInstruction < bvmf.131.01>**, solicitando liquidação antecipada do contrato de aluguel de ativos;

- Se houver informação inválida na mensagem **ContractEarlySettlementInstruction < bvmf.131.01>**, a BM&FBOVESPA envia a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>** ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor das posições do contrato de aluguel de ativos com o status de erro e o motivo do erro.

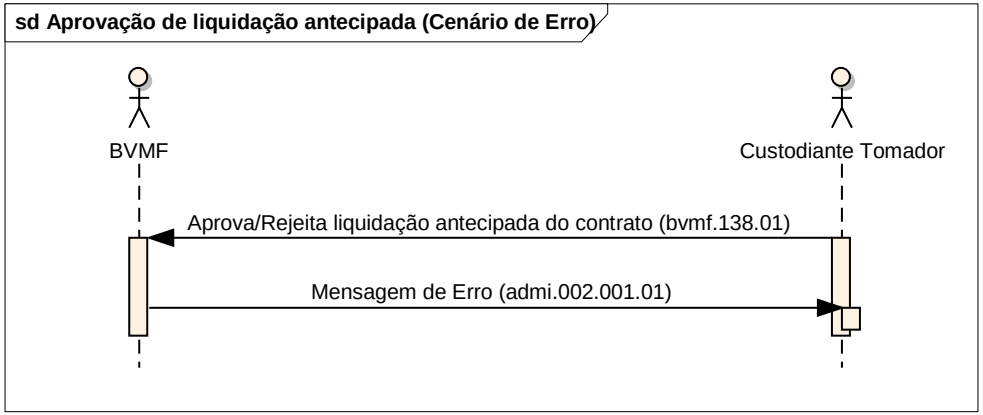


Cenário 4- Aprovação de Liquidação Antecipada de Contrato Aluguel de Ativos com Erro

Este cenário é utilizado para o participante aprovar a liquidação antecipada dos contratos de empréstimo de ativos em aberto (aluguel de ativos).

- O Custodiante Tomador envia à BM&FBOVESPA a mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, com a aprovação ou rejeição da liquidação antecipada do contrato de aluguel de ativos;

- Se houver informação inválida na mensagem **ContractApprovalResponse <bvmf.138.01>**, a BM&FBOVESPA envia uma mensagem de erro (admi.002.001.01) ao Custodiante Tomador com o código referente ao motivo da rejeição.

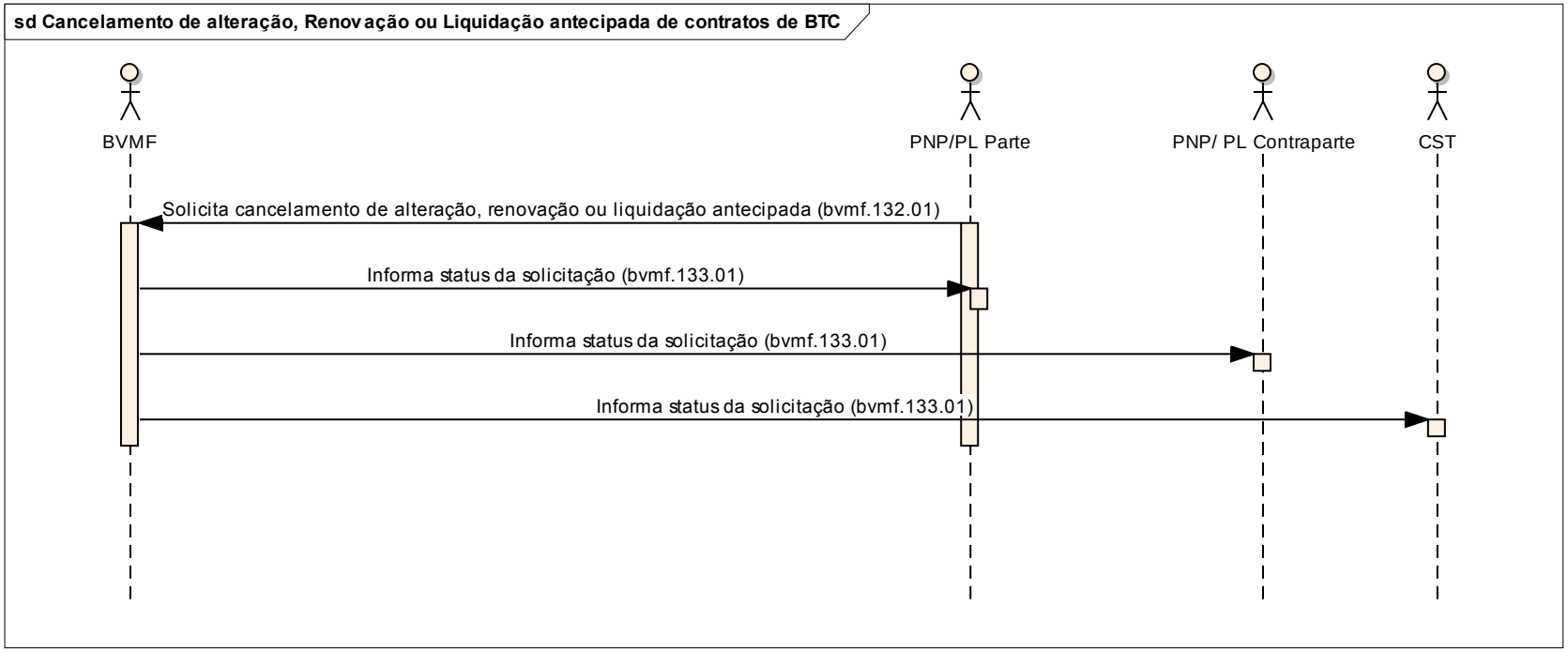

sd Aprovação de liquidação antecipada (Cenário de Erro)
BVMF
Custodiante Tomador
Aprova/Rejeita liquidação antecipada do contrato (bvmf.138.01)
Mensagem de Erro (admi.002.001.01)

Cancelamento de Alteração, Renovação ou Liquidação Antecipada do Contrato de BTC em aberto

Cenário 1- Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Solicita Cancelamento de Alteração, Renovação ou Liquidação Antecipada de Contrato de BTC com Sucesso

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte que solicitou alteração, renovação ou liquidação antecipada envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractCancellationInstruction <bvmf.132.01>**, solicitando o cancelamento da alteração, renovação ou liquidação antecipada do contrato de aluguel de ativos;

- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno/Participante de Liquidação Parte e Contraparte e Custodiante a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, informando a situação da solicitação de cancelamento da alteração, renovação ou liquidação antecipada do contrato;

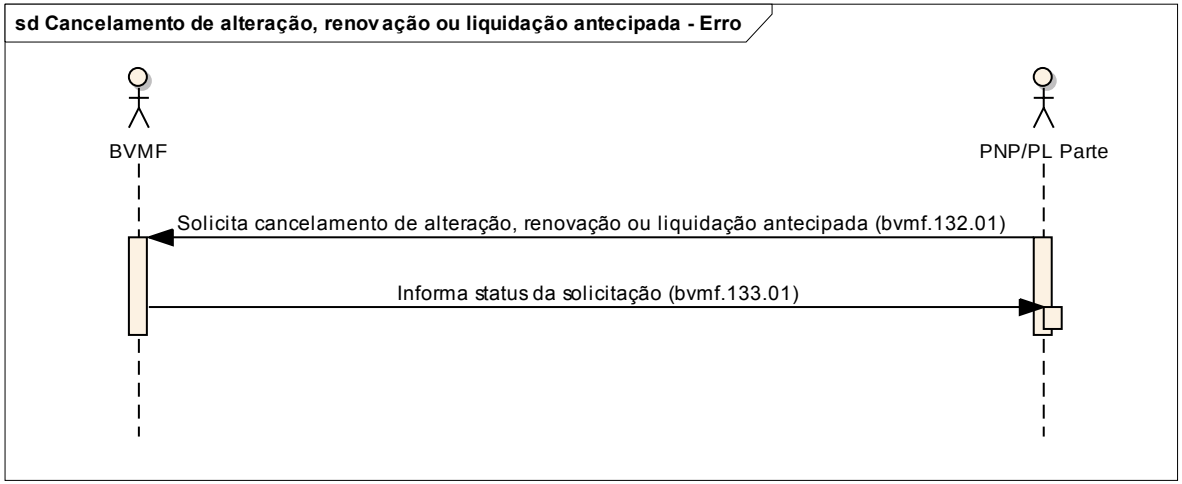

sd Cancelamento de alteração, Renovação ou Liquidação antecipada de contratos de BTC
BVMF
PNP/PL Parte
PNP/ PL Contraparte
CST
Solicita cancelamento de alteração, renovação ou liquidação antecipada (bvmf.132.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Cenário 2- Solicitação de Cancelamento e Alteração, Renovação ou Liquidação Antecipada de Contrato de BTC com Erro

Este cenário é utilizado para o participante solicitar o cancelamento de alteração, renovação ou liquidação antecipada de contratos de empréstimo de ativos em aberto .

- O Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação Parte que solicitou alteração, renovação ou liquidação antecipada envia à BM&FBOVESPA, a mensagem **ContractCancellationInstruction <bvmf.132.01>**, solicitando o cancelamento da alteração, renovação ou liquidação antecipada do contrato de aluguel de ativo;

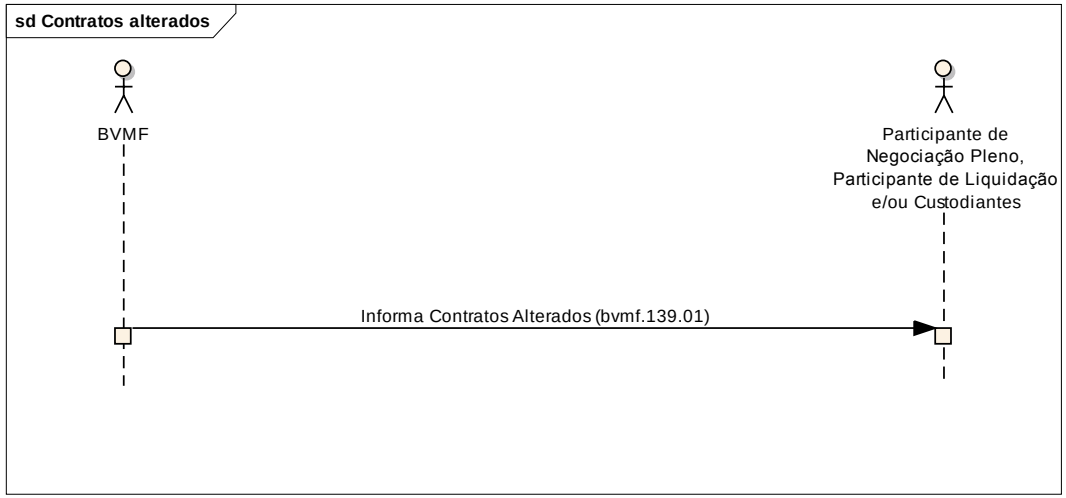
- Se houver informação inválida na mensagem **ContractCancellationInstruction <bvmf.132.01>**, a BM&FBOVESPA envia a mensagem **ContractStatusAdvice <bvmf.133.01>**, ao Participante de Negociação Pleno Parte e Participante de Liquidação Parte com o status de erro e o motivo do erro.


sd Cancelamento de alteração, renovação ou liquidação antecipada - Erro
BVMF
PNP/PL Parte
Solicita cancelamento de alteração, renovação ou liquidação antecipada (bvmf.132.01)
Informa status da solicitação (bvmf.133.01)

Informa contratos alterados

Cenário1- BM&FBOVESPA informa os contratos alterados ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes.

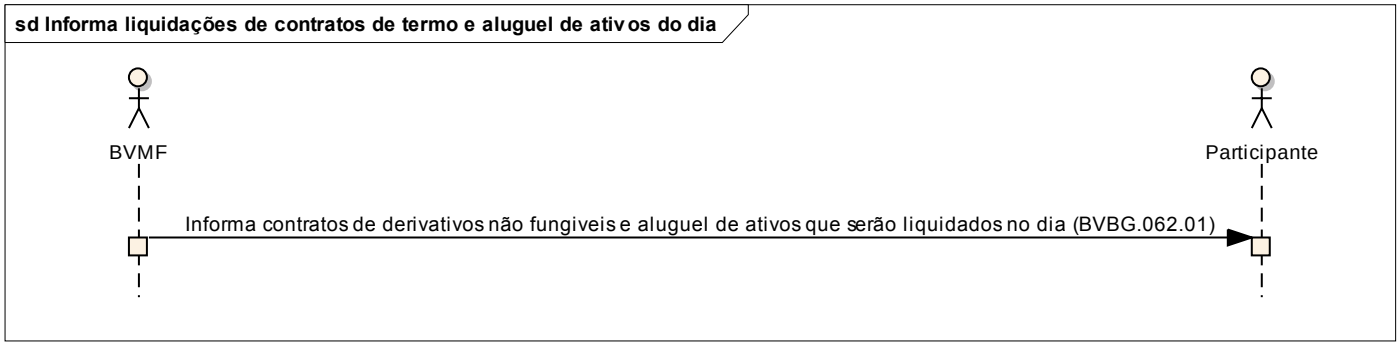
- A BM&FBOVESPA envia ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes o arquivo **ContractModificationReport <BVBG.061.01>**, informando os contratos alterados do dia.


sd Contratos alterados
BVMF
Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes
Informa Contratos Alterados (bvmf.139.01)

Informa Liquidações de Contratos Derivativos Não Fungíveis e Aluguel de Ativos do Dia

Cenário1- BM&FBOVESPA informa as liquidações dos contratos de derivativos não fungíveis e aluguel de ativos do dia ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação e Custodiantes.

- A BM&FBOVESPA envia ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes o arquivo **ContractSettlementReport <BVBG.062.01>**, informando os contratos de derivativos não fungíveis e de aluguel de ativos que serão liquidados no dia.

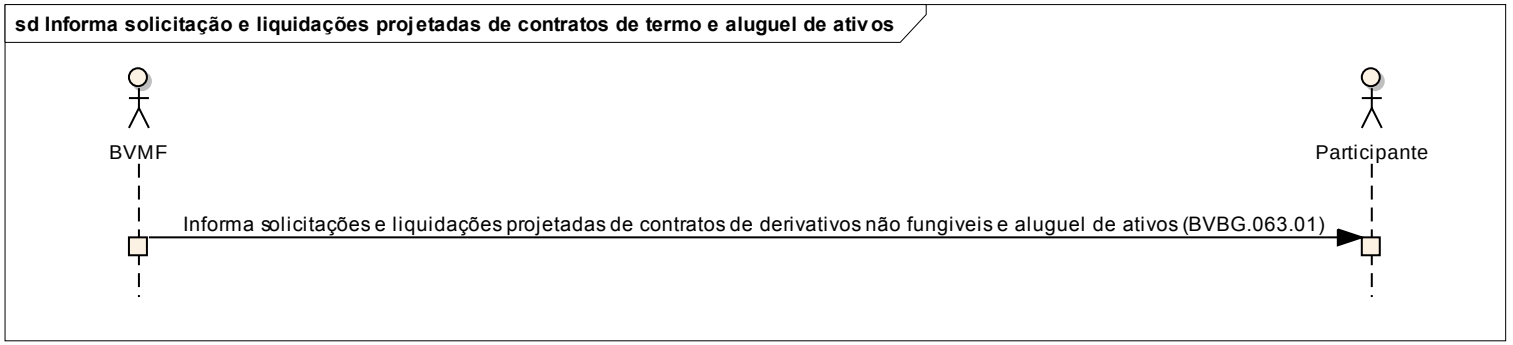

sd Informa liquidações de contratos de termo e aluguel de ativos do dia
BVMF
Participante
Informa contratos de derivativos não fungiveis e aluguel de ativos que serão liquidados no dia (BVBG.062.01)

Informa Liquidações Antecipadas de Contratos Derivativos Não Fungíveis e Aluguel de Ativos

Cenário1- BM&FBOVESPA informa liquidações antecipadas dos contratos de derivativos não fungíveis e aluguel de ativos ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno e Participante de Liquidação e Custodiantes.

- A BM&FBOVESPA envia ao Membro de Compensação, Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes o arquivo **EarlySettlementReport <BVBG.063.01>**, informando as liquidações projetadas dos contratos de derivativos não fungíveis e de aluguel de ativos.

Este arquivo também é enviado como informe das solicitações de liquidações antecipadas.


sd Informa solicitação e liquidações projetadas de contratos de termo e aluguel de ativos
BVMF
Participante
Informa solicitações e liquidações projetadas de contratos de derivativos não fungiveis e aluguel de ativos (BVBG.063.01)

bvmf.026.01 - Mensagem de Solicitação do Arquivo de Posição em Aberto (SecuritiesStatementQueryV02)

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde MCs, PNPs, PLs e Custodiantes podem solicitar de forma intradiária as informações momentâneas de posições em aberto nos mercados da BM&FBOVESPA atendidos pelo sistema de Controle de Posição. Os custodiantes somente podem solicitar informações referente a posições no mercado à vista, de falha de entrega e recompra.

Uso

Esta mensagem permite uma série de filtros para atender as necessidades específicas do participante. Pode-se filtrar o instrumento, datas, carteira e tipo de posição.

Custodiantes somente podem consultar posições de mercado à vista, falha de entrega e recompra.

Diagrama da Mensagem

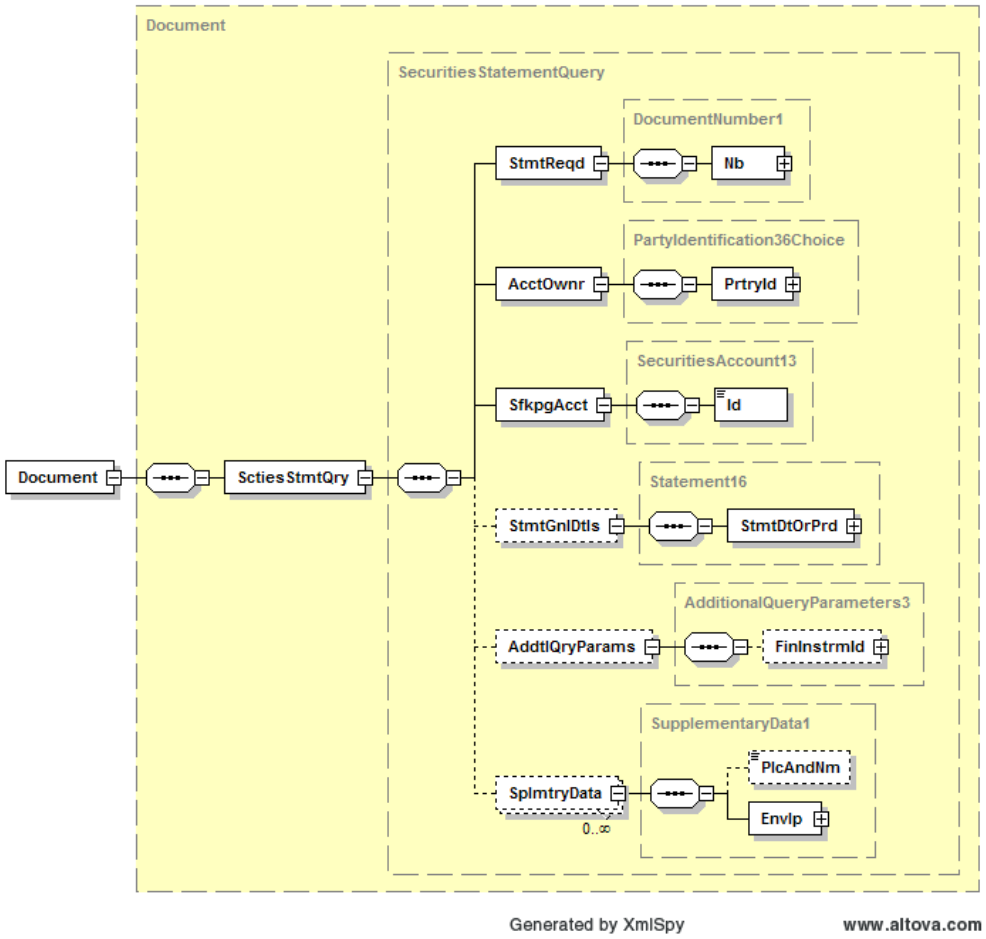
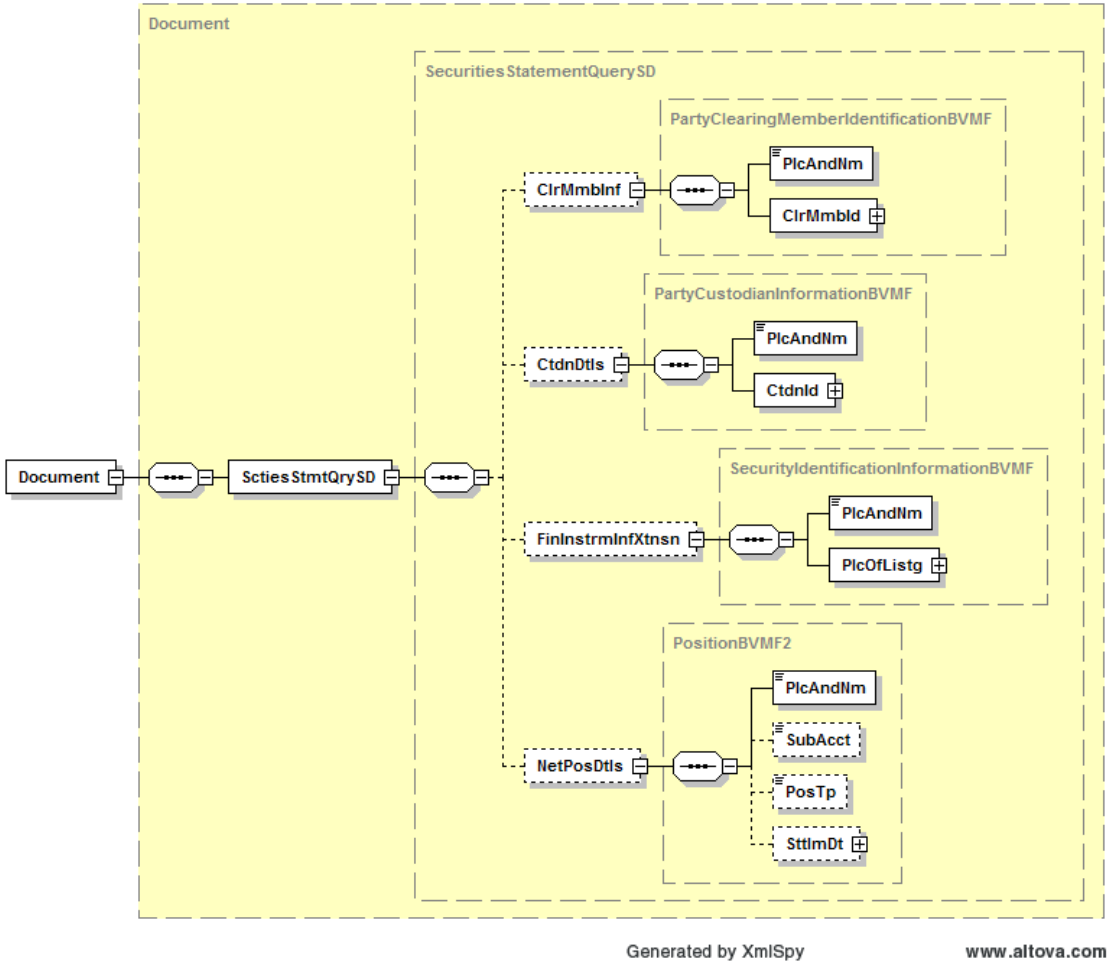


Diagrama do Supplementary Data


Document
SecuritiesStatementQuerySD
PartyClearingMemberIdentificationBVMF
ClrMmbInf
PlcAndNm
ClrMmbId
PartyCustodianInformationBVMF
CtdnDtls
PlcAndNm
CtdnId
SecurityIdentificationInformationBVMF
FinInstrmInfXtnsn
PlcAndNm
PlcOfListg
PositionBVMF2
NetPosDtls
PlcAndNm
SubAcct
PosTp
SttlmDt
Document
SctiesStmtQrySD
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

Regra 1 – Somente pode ser consultada a posição do dia ou dia seguinte, em caso de posição gerada por negócios de after-hours.

Regra 2 – O campo MC é obrigatório no caso de solicitação oriunda deste participante.

Regra 3 – Se a consulta é originada de custodiante, os campos de código de custodiante e conta de custódia devem ser preenchidos.

Regra 4 – Para a consulta utilizando o filtro de instrumento, se faz necessário informar os três atributos que identificam o instrumento dentro da Câmara, ou seja, *Exchange ID, Security Source e Security ID.*

Estrutura da mensagem bvmf.026.01 - SecuritiesStatementQueryV02

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		StatementRequested	StmtReqd	[1..1]	+	Description of the statement requested.	Este bloco identifica o “arquivo” solicitado.	
1.1		Number	Nb	[1..1]	+	Number used to identify a file.	Número utilizado para identificar o arquivo.	
1.1.1		ProprietaryNumber	PrtryNb	[1..1]	+	Proprietary number used to identify a file.	Número proprietário utilizado para identificar o arquivo.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	RestrictedFINXMax30Text	Identification used to file. E.g: BVBG.017.01.	Identificação utilizada para o arquivo. Ex: BVBG..017.01.	
2.0		AccountOwner	AcctOwnr	[1..1]	+	This block identifies the participant (TP, PL).	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL)	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SafekeepingAccount	SfkpgAcct	[1..1]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta	
3.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.0		StatementGeneralDetails	StmtGnlDtls	[0..1]	+	General information related to report.	Informações gerais relacionadas a solicitação de posição.	R1
4.1		StatementDateOrPeriod	StmtDtOrPrd	[1..1]	+	Date or period of the statement.	Data da posição.	
4.1.1		StatementDate	StmtDt	[1..1]	+	Date of the statement.	Data da posição.	
4.1.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica a data da posição.	

5.0		AdditionalQueryParameters	AddtlQryParams	[0..1]	+	Additional specific query criteria.	Este bloco contém os critérios de consulta para posição.	
5.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
5.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Este bloco contém a identificação proprietária de um instrumento.	
5.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	R4
5.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
5.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	R4
6.0		SupplementaryData	SplmtryData	[0..*]	+	Additional information that cannot be captured in the structured elements and/or any other specific block.	Elemento opcional, que permite que dados adicionais sejam localizados em algum ponto específico na mensagem se necessário (PlaceAndName). Usados para incorporar as extensões BM&FBOVESPA. Essas extensões são dados ou conceitos que não são suportados pela mensagem ISO, porém, são necessários para o mercado brasileiro	
6.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[0..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. In the case of XML, this is expressed by a valid XPath.	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem.	
6.2		Envelope	Envlp	[1..1]	+	Technical element wrapping the supplementary data.	Elemento técnico envolvendo os dados complementares. No caso de um arquivo XML, este deve ser validado por um novo schema XSD.	
6.2.1		Contents	Cnts	[1..1]	+	Technical element that specifies the supplementary data.	Elemento técnico que especifica os dados complementares.	

Estrutura da mensagem Supplementary Data - SUPL.026.01 - SecuritiesStatementQuerySD

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ClearingMemberInformation	ClrMmbInf	[0..1]	+	This block identifies the clearing member.	Este bloco identifica o membro de compensação.	R2
1.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesStmtQry	
1.2		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informações do Membro de Compensação.	
1.2.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
1.2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

1.2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2,0		CustodianDetails	CtdnDtls	[0..1]	+	This block identifies the custodian and safekeeping account.	Este bloco identifica o custodiante e a conta de custódia.	R3
2.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido. //Document/SctiesStmtQry	
2.2		CustodianIdentification	CtdnId	[1..1]	+	Block contains the identity of the custodian and the safekeeping account	Bloco que contém a identificação do custodiante e da conta de custódia.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Party that legally owns the account.	Este bloco identifica o custodinate	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP(Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:	

							Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.0		FinancialInstrumentInformationExtension	FinInstrmInfXtnsn	[0..1]	+	Block contains information of the instrument	Este bloco contem informações adicionais de instrumento que não foram abordadas na mensagem original.	
3.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry/AddtlQryParams/FinInstrmInf	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesStmtQry/AddtlQryParams/FinInstrmInf	
3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market(s) on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.2.1	{OR	MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	R4
4.0		NetPositionDetails	NetPosDtls	[0..1]	+	Provides the net positions details.	Fornece detalhes das informações de posição.	

4.1		PlaceAndName	PlcAndNm	[1..1]	Max350Text	Unambiguous reference to the location where the supplementary data must be inserted in the message instance. xPath to the element that is being extended //Document/SctiesStmtQry	Referência inequívoca para o local onde os dados adicionais devem ser inseridos na mensagem. O xPath do elemento que está sendo estendido é //Document/SctiesStmtQry	
4.2		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
4.3		PositionType	PosTp	[0..1]	ExternalPositionTypeCode	Cash Market, Settlement failure, Buy in, Fungible Derivatives and Physical Delivery. The "PositionType" field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is "ExternalPositionTypeCode" in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Contém os tipos de posição disponível para ser solicitado via mensageria. Ex: Cash Market, Settlement failure, Buy in, Fungible Derivatives and Physical Delivery. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é "ExternalPositionTypeCode" no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.4		SettlementDate	SttlmDt	[0..1]	+	Settlement date of position	Este bloco contém a data de liquidação.	
4.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário.	

BVBG.017.02 – Arquivo de posição em aberto nível de conta (PositionReportAccountLevel)

O arquivo “PositionReport” (BVBG.017.02) é composto pelas seguintes mensagens:

bvmf.027.01 – FungibleDerivativesPositionReport

bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport

bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport

bvmf.096.01 – BuyInPositionReport

bvmf.097.01 – CashMarketPositionReport

bvmf.098.01 – NonFungibleDerivativesPositionReport

bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport

bvmf.034.01 – SecuritiesLendingPositionReport

Este arquivo de posição em aberto é gerado no nível de conta, disponível para MCs, PNPs, PLs e Custodiantes.

bvmf.027.02 – FungibleDerivativesPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto nos mercados de derivativos fungíveis, basicamente posições de futuros, opções e swap cambial com ajuste periódico.

Uso

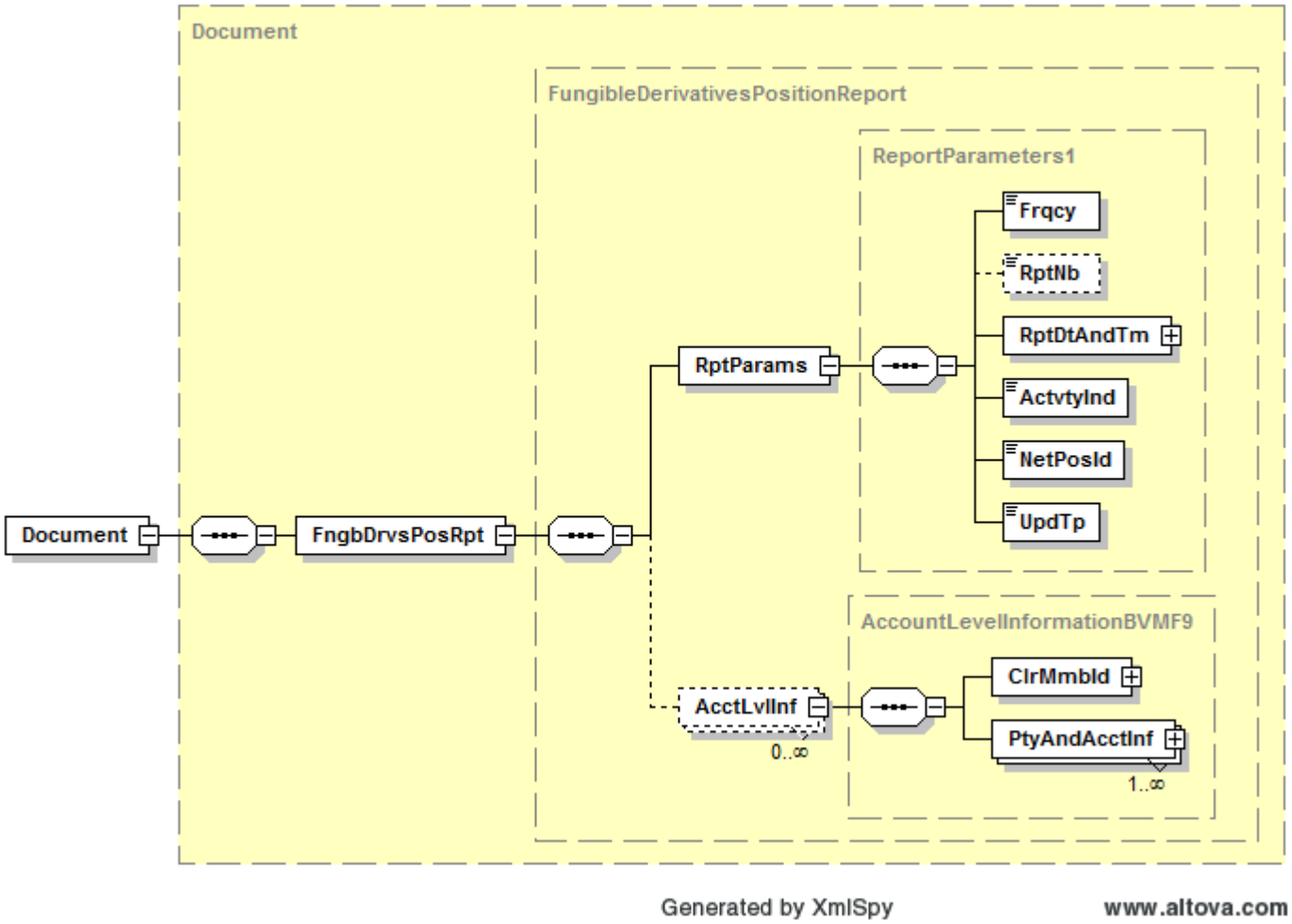
Esta mensagem traz informações de posição inicial, movimentações de posição, posição atual e cálculos financeiros. As posições são atualizadas de acordo com a chegada de eventos de movimentação, como por exemplo, novos negócios e alocações, transferências, baixas de posição, novos preços, etc.

Os cálculos financeiros são atualizados de acordo com a movimentação de posições e a chegada de novas informações de preço. Quando os preços utilizados são de caráter provisório isto é informado no arquivo.

Este arquivo traz informações específicas de contratos futuros, de opções, de opções sobre ações e swap cambial, dessa forma, alguns campos são aplicáveis somente a alguns mercados.

É importante destacar que um arquivo solicitado durante o dia pode ser alterado devido a movimentações de posições ou novas informações de preço, dessa forma, os arquivos de posição trazem indicativo se o arquivo foi gerado por solicitação ou ao final do dia no processamento final do sistema.

Diagrama da Mensagem


Document
FungibleDerivativesPositionReport
ReportParameters1
Frqcy
RptNb
RptDtAndTm
ActvtyInd
NetPosId
UpdTp
RptParams
Document
FngbDrvsPosRpt
AccountLevelInformationBVMF9
ClrMmbId
PtyAndAcctInf
1..∞
AcctLvlInf
0..∞
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1 – Não aplicável a opções sobre ações.

R2 – Os campos abaixo somente terão informação quando da inclusão de opções sobre ação no Controle de Posição:

- Distribuição da opção;
- ISIN do ativo objeto;
- Distribuição do ativo objeto;
- Indicador tipo de série;
- Fator de cotação;
- Posição vendida coberta;
- Posição vendida descoberta; e
- Posição de BOX.

R3 – Aplicável somente para posições de opções.

R4 – Aplicável somente para posições de swap cambial.

Estrutura da Mensagem bvmf.027.02 – FungibleDerivativesPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	

1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides Account Level Information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informações do Membro de Compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account	Este bloco identifica o participante (PNP pu PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Proprietary information, often a code, issued by the data source scheme issuer. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456 TP (Trade Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações sobre a conta do participante.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		FungibleDerivativesPositionInformation	FngbDrvsPosInf	[1..*]	+	This block describles the Fungible Derivatives Position.	Informações da Posição de Derivativos Fungíveis.	
2.2.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	

2.2.2.2.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.2.2.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	

2.2.2.2.3		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é	

							ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.2.3.2		RoundLotContractSize	RndLotCtrctSz	[1..1]	DecimalNumber	For options on equities= Round lot For financial and comoditties derivatives = Contract multiplier Definition Round lot: Multiple and minimum quantity of securities that can be purchased or sold. Definiiton Contract size: Ratio or multiplying factor used to convert the contract quotation to the contract size	Para opções sobre equities = Lote padrão. Para derivativos de comoditties e financeiros= Multiplicador do contrato Definição de Lote padrão: Quantidade mínima e múltiplia de papéis que pode ser adquirida ou vendida. Definição de tamanho do contrato: Relação ou fator de multiplicação utilizado para converter a cotação do contrato no tamanho do contrato.	
2.2.2.2.3.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.2.3.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção	R1

							A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.2.3.5		ExpirationCodeTypeIndicator	XprtnCdTpInd	[0..1]	ExternalExpirationCodeTypeIndicatorCode	Series type indicator. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalExpirationCodeTypeIndicatorCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Indicador do tipo da série. Este campo depende de uma lista externa de códigos. Os códigos e valores estão em uma planilha de códigos para permitir uma manutenção flexível em função das necessidades de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso, a lista é "ExternalExpirationCodeTypeIndicatorCode" e está disponível no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	R2
2.2.2.2.3.6		OptionDistributionIdentification	OptnDstrbtnId	[0..1]	int	Distribution number of the option.	Número de distribuição da opção.	R2

2.2.2.2.3.7		UnderlyingInstrument	UndrlygInstrm	[0..1]	Max12Text	Underlying Security Identifier International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	Identificador do instrumento subjacente. INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	R2
2.2.2.2.3.8		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Option's underlying asset distribution code.	Número da distribuição do ativo objeto da opção.	R2
2.2.2.2.3.9		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado em que o titular de um derivativo vai comprar ou vender um instrumento subjacente.	R3
2.2.2.2.3.9.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Exercise Price.	Preço de exercício.	

2.2.2.2.3.10		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente).	R3
2.2.2.2.3.10.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Este bloco identifica se o tipo da opção. Opção de compra (direito de comprar o ativo subjacente da opção) ou opção de venda (direito de vender o ativo subjacente da opção). Valores válidos: CALL PUTT	
2.2.2.2.3.11		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	R2
2.2.2.2.3.12		OptionStyle	OptnStyle	[0..1]	+	Specifies how an option can be exercised (American, European, Bermudan)	Informa como a opção pode ser exercida. Ex: Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento.	R3
2.2.2.2.3.12.1		Code	Cd	[1..1]	OptionStyle2Code	Option style expressed as an ISO 20022 code.	Informa como a opção pode ser exercida. Ex: Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento. Valores Válidos AMER ou EURO.	
2.2.2.2.3.13		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	ISODate	Expiration Date.	Data de Vencimento.	
2.2.2.2.4		PositionDate	PosDt	[1..1]	ISODate	Position Date.	Data da posição	
2.2.2.2.5		InitialLongQuantity	InitlLngQty	[0..1]	DecimalNumber	Initial long position	Posição Inicial Comprada	
2.2.2.2.6		InitialShortQuantity	InitlShrtQty	[0..1]	DecimalNumber		Posição Inicial Vendida.	
2.2.2.2.7		ExpiredLongQuantity	ExprLngQty	[0..1]	DecimalNumber	The quantity of long positions that has been expired.	Posição vencida comprada	

2.2.2.2.8		ExpiredShortQuantity	ExprShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	The quantity of short positions that has been expired	Posição vencida vendida.	
2.2.2.2.9		ClosedDueToExerciseLongQuantity	ClsdDueToExrcLngQty	[0..1]	DecimalNumber	Long position closed due to exercise.	Posição comprada encerrada por exercício.	
2.2.2.2.10		ClosedDueToExerciseShortQuantity	ClsdDueToExrcShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Short position closed due to exercise.	Posição vendida encerrada por exercício	
2.2.2.2.11		PurchaseOnDay	PurchsOnDay	[0..1]	DecimalNumber	Quantity purchased on the day.	Quantidade comprada no dia.	
2.2.2.2.12		SaleOnDay	SaleOnDay	[0..1]	DecimalNumber	Quantity sold on the day.	Quantidade vendida no dia.	
2.2.2.2.13		SentTransferLongQuantity	SntTrfLngQty	[0..1]	DecimalNumber	Long position sent by transfer.	Posição comprada enviada por transferência.	
2.2.2.2.14		SentTransferShortQuantity	SntTrfShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Short position sent by transfer.	Posição vendida enviada por transferência.	
2.2.2.2.15		ReceivedTransferLongQuantity	RcvdTrfLngQty	[0..1]	DecimalNumber	Long position received by transfer.	Posição comprada recebida por transferência.	
2.2.2.2.16		ReceivedTransferShortQuantity	RcvdTrfShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Short position received by transfer.	Posição vendida recebida por transferência.	
2.2.2.2.17		ClosedDueToPhysicalLongDelivery	ClsdDueToPhysLngDlvry	[0..1]	DecimalNumber	Long position closed due to physical delivery.	Posição comprada encerrada por entrega física.	
2.2.2.2.18		ClosedDueToPhysicalShortDelivery	ClsdDueToPhysShrtDlvry	[0..1]	DecimalNumber	Short position closed due to physical delivery.	Posição vendida encerrada por entrega física.	
2.2.2.2.19		CurrentLongQuantity	CurLngQty	[0..1]	DecimalNumber	Current long position.	Posição atual comprada.	
2.2.2.2.20		CurrentShortQuantity	CurShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Current short position.	Posição atual vendida.	
2.2.2.2.21		CurrentLongQuantityCorporateAction	CurLngQtyCorpActn	[0..1]	DecimalNumber	Current long position after corporate action. This information shall be provided and only shall be different from the current long position in the case of events on stock options.	Posição atual comprada apos eventos corporativos. Esta informação sempre será fornecida e somente será diferente da posição atual comprada no caso de eventos sobre opções de ações.	
2.2.2.2.22		CurrentShortQuantityCorporateAction	CurShrtQtyCorpActn	[0..1]	DecimalNumber	Current short position after corporate action. This information shall be provided and only shall be different from the current short position in the case of events on stock options.	Posição atual vendida apos eventos corporativos. Esta informação sempre será fornecida e somente será diferente da posição atual vendida no caso de eventos sobre opções de ações.	
2.2.2.2.23		CoveredShortQuantity	CvrdShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Covered short position.	Posição vendida coberta.	R2
2.2.2.2.24		UncoveredShortQu	UcvrdShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Not covered short position.	Posição vendida descoberta.	R2

		antity						
2.2.2.2.25		BOXPosition	BOXPos	[0..1]	DecimalNumber	Position quantity part of a BOX strategy.	Quantidade da posição pertencente a uma estratégia de BOX.	R2
2.2.2.2.26		ClosedLongQuantity	ClsdLngQty	[0..1]	DecimalNumber	Closed long position.	Posição comprada encerrada.	
2.2.2.2.27		ClosedShortQuantity	ClsdShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Closed short position.	Posição vendida encerrada.	
2.2.2.2.28		PositionFinancialLongAmount	PosFinLngAmt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Long position value.	Valor da posição comprada.	
2.2.2.2.29		PositionFinancialShortAmount	PosFinShrtAmt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Short position value.	Valor da posição vendida.	
2.2.2.2.30		VariationMarginCredit	VartnMrgnCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation Margin.	Ajuste diário.	
2.2.2.2.31		VariationMarginDebit	VartnMrgnDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation Margin.	Ajuste diário.	
2.2.2.2.32		InitialPositionVariationMarginCredit	InitlPosVartnMrgnCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin related to the initial position.	Ajuste diário relacionado a posição inicial.	
2.2.2.2.33		InitialPositionVariationMarginDebit	InitlPosVartnMrgnDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin related to the initial position.	Ajuste diário relacionado a posição inicial.	
2.2.2.2.34		VariationMarginTransferReceivedCredit	VartnMrgnTrfRcvdCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin related to the position received by transfer.	Ajuste diário referente a posição recebida por transferência.	
2.2.2.2.35		VariationMarginTransferReceivedDebit	VartnMrgnTrfRcvdDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin related to the position received by transfer.	Ajuste diário referente a posição recebida por transferência.	
2.2.2.2.36		TradeOfDayVariationMarginCredit	TradOfDayVartnMrgnCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin related to the trades of the day.	Ajuste diário relacionado aos negócios do dia.	
2.2.2.2.37		TradeOfDayVariationMarginDebit	TradOfDayVartnMrgnDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin related to the trades of the day.	Ajuste diário relacionado aos negócios do dia.	
2.2.2.2.38		CumulativeVariationMarginCredit	CmltvVartnMrgnCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cumulative variation margin.	Ajuste acumulado.	
2.2.2.2.39		CumulativeVariationMarginDebit	CmltvVartnMrgnDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cumulative variation margin.	Ajuste acumulado.	
2.2.2.2.40		VariationMarginClo	VartnMrgnClsd	[0..1]	RestrictedBVMF3Acti	Cumulative variation margin applicable over	Ajuste acumulado aplicado sobre a	

		sedPositionCredit	PosCdt		veOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	the closed position.	posição encerrada.	
2.2.2.2.41		VariationMarginClosedPositionDebit	VartnMrgnClsdPosDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cumulative variation margin applicable over the closed position.	Ajuste acumulado aplicado sobre a posição encerrada.	
2.2.2.2.42		PremiumCredit	PrmCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Options premium.	Prêmio de opção.	
2.2.2.2.43		PremiumDebit	PrmDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Options premium.	Prêmio de opção.	
2.2.2.2.44		FinalValueLegVariableCode	FnlValLegVarblCd	[0..1]	+	Final Value Leg Variable Code.	Código Variável Valor Final.	R4
2.2.2.2.44.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.2.45		DaysNetPositionFinalCredit	DaysNetPosFnlCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Net Position - Final Value Leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Valor Final	R4
2.2.2.2.46		DaysNetPositionFinalDebit	DaysNetPosFnlDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Net Position - Final Value Leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Valor Final	R4
2.2.2.2.47		ValueReceivedByTransferFinalCredit	ValRcvdByTrfFnlCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Received by Transfer - Final Value Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável Valor Final.	R4
2.2.2.2.48		ValueReceivedByTransferFinalDebit	ValRcvdByTrfFnlDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Received by Transfer - Final Value Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável Valor Final.	R4
2.2.2.2.49		ValueSentByTransferFinalCredit	ValSntByTrfFnlCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value sent by transfer - Final Value Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável Valor Final.	R4
2.2.2.2.50		ValueSentByTransferFinalDebit	ValSntByTrfFnlDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value sent by transfer - Final Value Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável Valor Final.	R4
2.2.2.2.51		DaysUpdatedPositionFinalCredit	DaysUpdtdPosFnlCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Updated Position - Final Value Leg.	Posição atualizada do dia - Variável Valor Final.	R4
2.2.2.2.52		DaysUpdatedPositionFinalDebit	DaysUpdtdPosFnlDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Updated Position - Final Value Leg.	Posição atualizada do dia - Variável Valor Final.	R4

2.2.2.2.53		SpreadRateLegVariableCode	SprdRateLegVarblCd	[0..1]	+	Spread Rate Leg Variable Code.	Código Variável Cupom.	R4
2.2.2.2.53.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.2.54		DaysNetPositionSpreadCredit	DaysNetPosSprdCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Net Position – Spread rate leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Cupom	R4
2.2.2.2.55		DaysNetPositionSpreadDebit	DaysNetPosSprdDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Net Position – Spread rate leg.	Valor consolidado de negócios do dia - Variável Cupom	R4
2.2.2.2.56		ValueReceivedByTransferSpreadCredit	ValRcvdByTrfSprdCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Received by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável cupom.	R4
2.2.2.2.57		ValueReceivedByTransferSpreadDebit	ValRcvdByTrfSprdDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Received by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor recebido por transferência no dia - Variável cupom	R4
2.2.2.2.58		ValueSentByTransferSpreadCredit	ValSntByTrfSprdCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Sent by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável Cupom.	R4

2.2.2.2.59		ValueSentByTransferSpreadDebit	ValSntByTrfSprdDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Value Sent by Transfer – Spread Rate Leg.	Valor enviado por transferência no dia - Variável cupom	R4
2.2.2.2.60		DaysUpdatedPositionSpreadCredit	DaysUpdtdPosSprdCdt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Updated Position - Spread Rate Leg.	Posição atualizada do dia - Variável Cupom	R4
2.2.2.2.61		DaysUpdatedPositionSpreadDebit	DaysUpdtdPosSprdDbt	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Day's Updated Position - Spread Rate Leg.	Contem informações sobre qual será a base de calculo utilizado para o preço de ajuste.	R4
2.2.2.2.62		CashSettlementCredit	CshSttlmCdt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cash settlement value.	Valor de Liquidação.	
2.2.2.2.63		CashSettlementDebit	CshSttlmDbt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Cash settlement value.	Valor de Liquidação.	
2.2.2.2.64		PricingInformation	PricgInf	[0..1]	ExternalBaseCalculationPricingCode	Contains information about which will be the basis of calculation used for the price adjustment. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalBaseCalculationPricingCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Contem informações sobre qual será a base de calculo utilizado para o preço de ajuste. Este campo depende de uma lista externa de códigos. Os códigos e valores estão em uma planilha de códigos para permitir uma manutenção flexível em função das necessidades de atualização da BM&FBOVESPA. Neste caso, a lista é ExternalBaseCalculationPricingCode e está disponível no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport

Funcionalidade da Mensagem

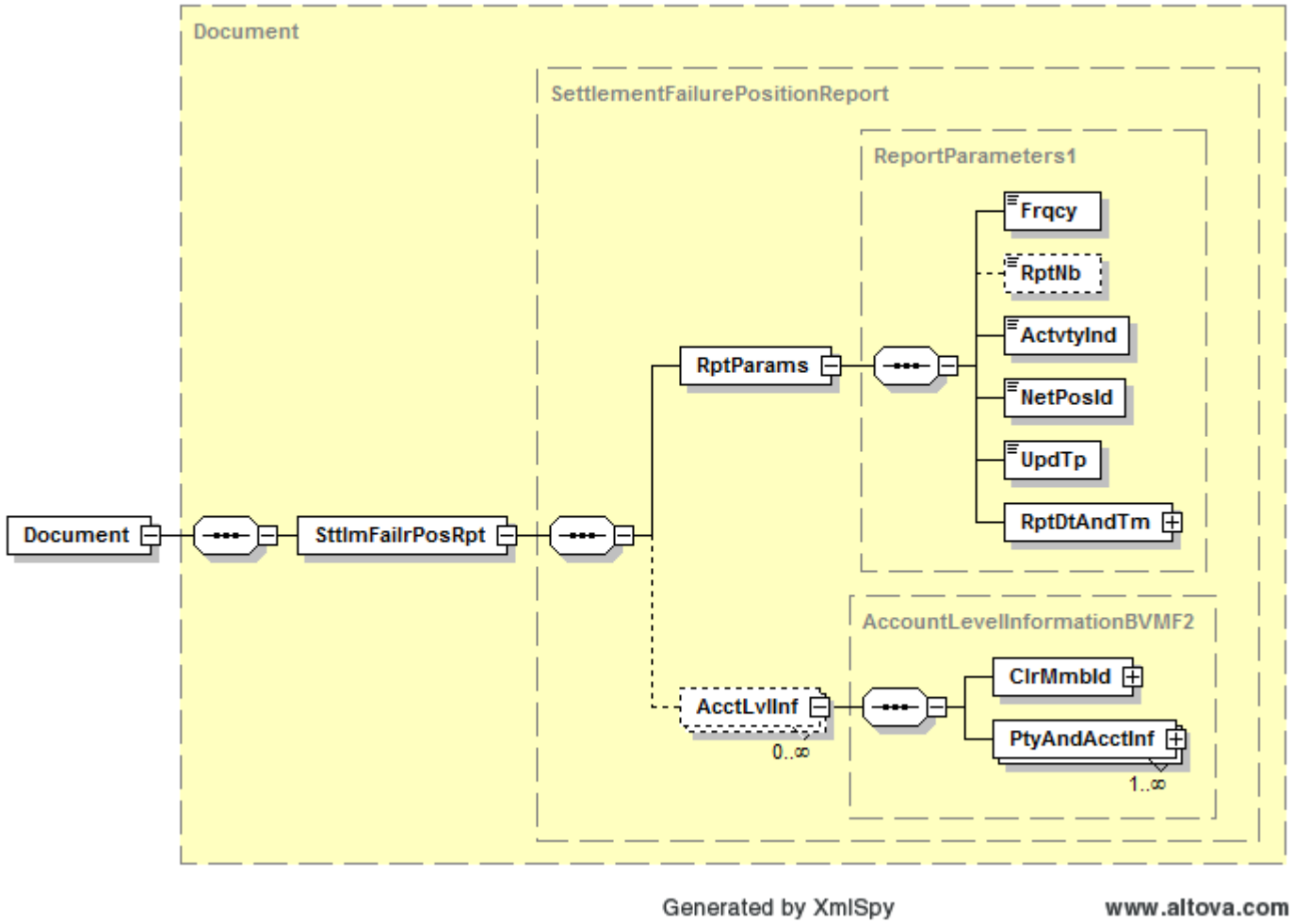
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto de falhas de entrega de ativos.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes acompanhar as posições com falha de entrega de ativos sob sua responsabilidade. Na primeira versão do sistema, estas posições não estarão disponíveis no sistema de Controle de Posições.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mensagem bvmf.094.01 – SettlementFailurePositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	

2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	

2.2.2.3		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.3.1		CustodianIdentification	CtdnId	[0..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.3.2		SafekeepingAccountInformation	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1		SafekeepingAccountIdentification	SfkpgAcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.3.2.2		SettlementFailureInformation	SttlmFailrInf	[1..*]	+	This block provides the Delivery Failure Position information.	Este bloco fornece informações das posições de falha de entrega.	
2.2.2.3.2.2.1		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.2.1.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	

2.2.2.3.2.2.2		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.2.2.2.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.3.2.2.3		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.3.2.2.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.4		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	Provides settlement date.	Informa a data de liquidação.	
2.2.2.3.2.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.5		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
2.2.2.3.2.2.6		LongQuantity	LngQty	[0..1]	+	Long quantity.	Quantidade comprada.	
2.2.2.3.2.2.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.7		LongAveragePrice	LngAvrgPric	[0..1]	+	Average long price.	Preço médio de compra.	
2.2.2.3.2.2.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average price.	Preço médio.	
2.2.2.3.2.2.8		LongGrossTradeAmount	LngGrssTradAmt	[0..1]	+	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	
2.2.2.3.2.2.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	
2.2.2.3.2.2.9		ShortQuantity	ShrtQty	[0..1]	+	Short quantity.	Quantidade vendida.	
2.2.2.3.2.2.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.10		ShortAveragePrice	ShrtAvrgPric	[0..1]	+	Average short price.	Preço médio de venda.	
2.2.2.3.2.2.10.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average price.	Preço médio.	
2.2.2.3.2.2.11		ShortGrossTradeAmount	ShrtGrssTradAmt	[0..1]	+	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	
2.2.2.3.2.2.11.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	

bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

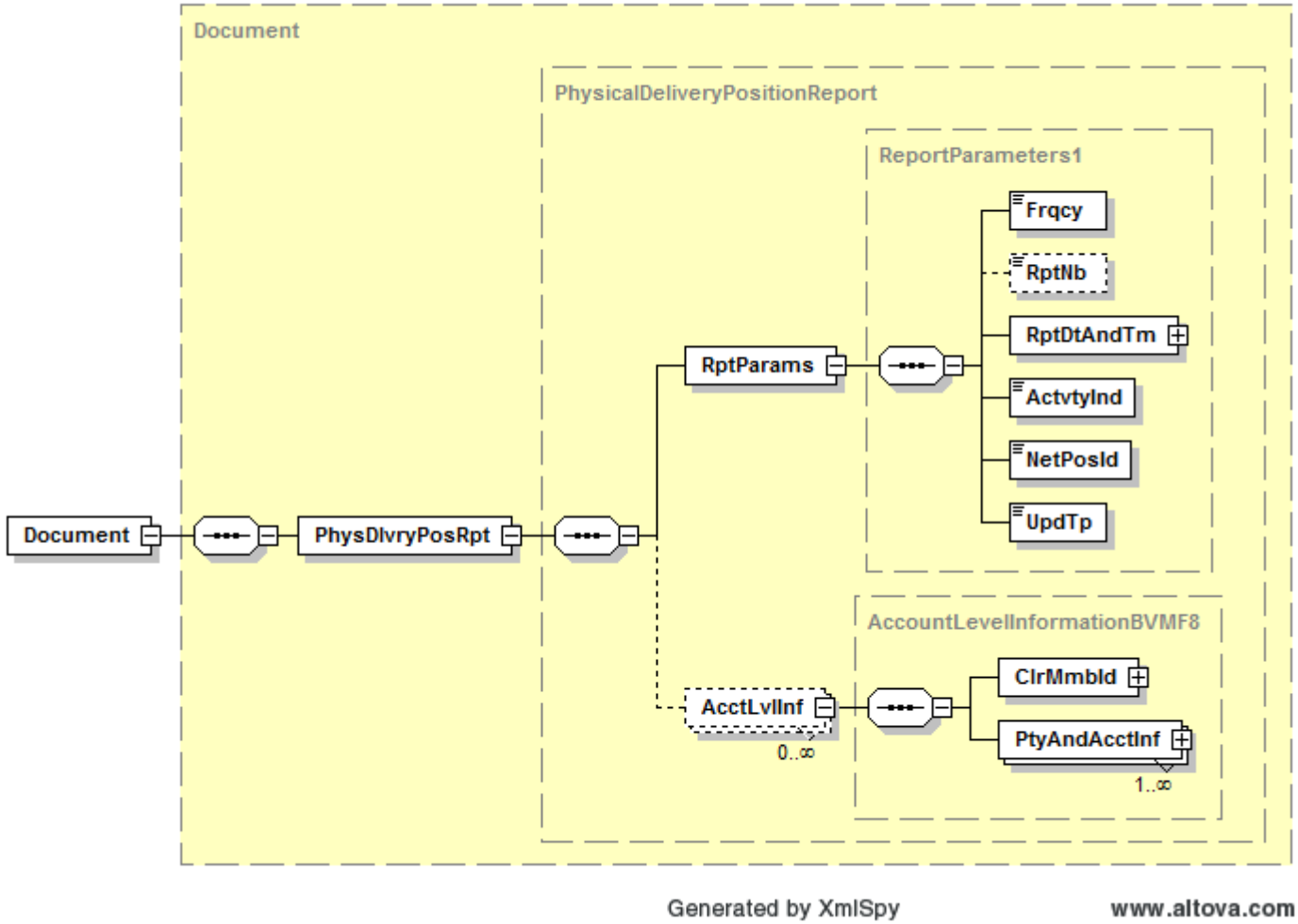
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto de commodities agrícolas em procedimento de entrega física.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs e MCs acompanhar as posições de commodities agrícolas em procedimento de entrega física sob sua responsabilidade. Após a posição de futuro ser baixada por entrega física, o sistema de Controle de Posições mantém a posição de entrega física até a sua efetiva liquidação.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mensagem bvmf.095.01 – PhysicalDeliveryPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	

2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única, como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista externa de códigos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso a identificação externa é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	

						115 = Account Number	115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		PhysicalDeliveryPositionInformation	PhysDlvryPosInf	[1..*]	+	This block describle the Physical Delivery Position.	Este bloco contém informações da posição de entrega física.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN	

2.2.2.3.2.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.3.3		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttr bts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

2.2.2.3.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarket Code	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[1..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4		DeliveryNoticeDate	DlvryNtceDt	[1..1]	+	Delivery Notice Allocation Date	Data de alocação do aviso de entrega.	

2.2.2.3.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.5		DeliveryPrice	DlvryPric	[1..1]	+	Delivery Price	Preço de Entrega.	
2.2.2.3.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Delivery price	Preço de Entrega.	
2.2.2.3.6		LongQuantityPosition	LngQtyPos	[0..1]	+	Describes the quantity purchased in Physical Delivery Process.	Posição comprada em procedimento de entrega física.	
2.2.2.3.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.7		ShortQuantityPosition	ShrtQtyPos	[0..1]	+	Describes the quantity sold in Physical Delivery Process.	Posição vendida em procedimento de entrega física.	
2.2.2.3.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

bvmf.096.01 – BuyInPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

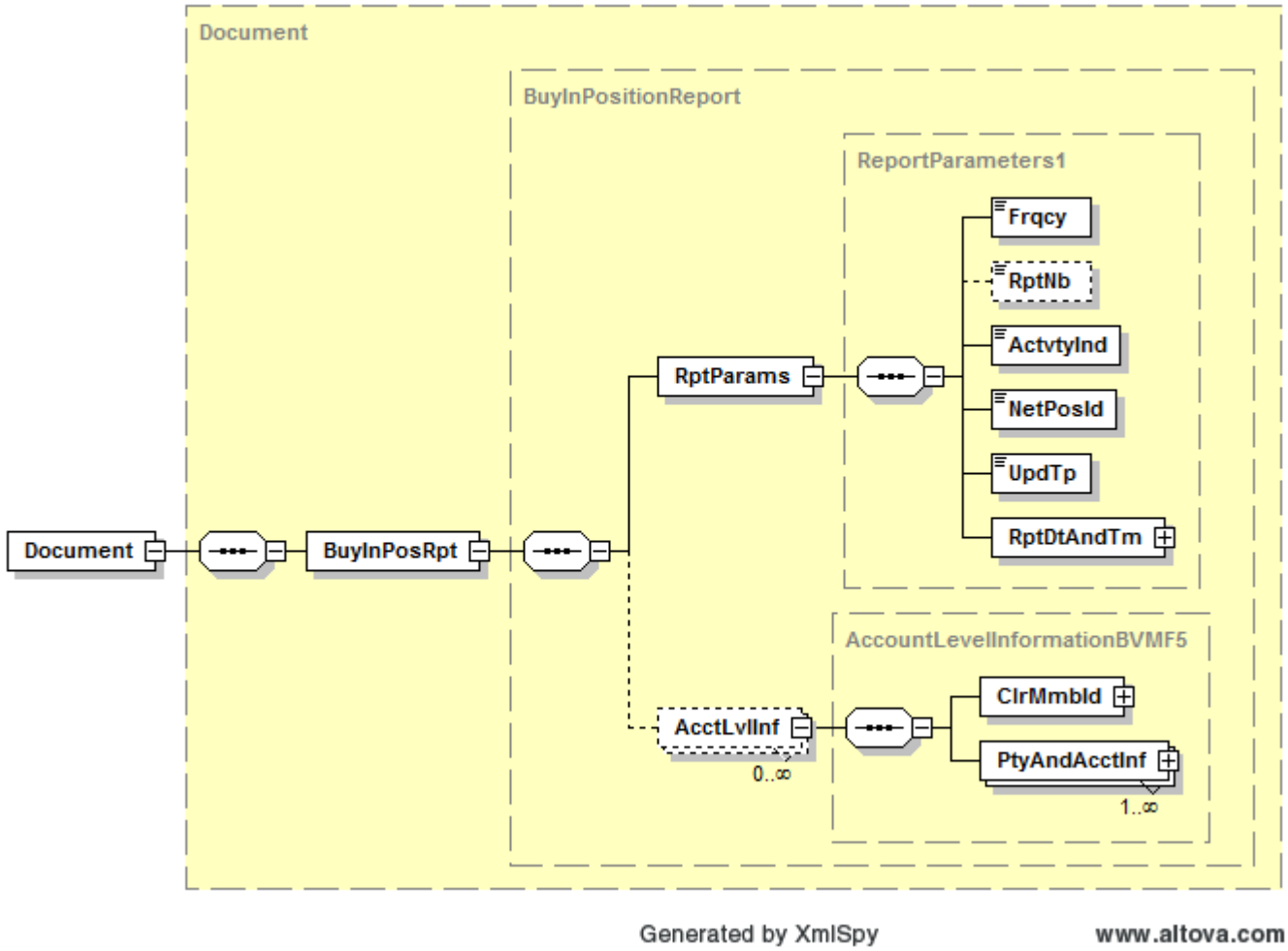
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto de recompra de ativos.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes acompanhar as posições de recompra de ativos sob sua responsabilidade. Na primeira versão do sistema, estas posições serão abertas somente em caso de falha de entrega de ouro a vista.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mnesagem bvmf.096.01 – BuyInPositionReport

Index	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericT ext	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default “true”.	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão “true”.	
1.4		NetPositionIdentifica tion	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdat eType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndT m	[1..1]	+	Date and time of the report.	Data e hora do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInform ation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIde ntification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution..	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentificat ion	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF This field should be filled with default value = 39	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.3.1		CustodianIdentification	CtdnId	[0..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de	

						proprietary identification scheme.	identificação proprietária.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.3.2		SafekeepingAccount Information	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1		SafekeepingAccount Identification	SfkpgAcctId	[0..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.3.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.3.2.2		BuyInPositionInform ation	BuyInPosInf	[1..*]	+	This block provides buy In position information.	Este bloco fornece informações da posição de Recompra.	
2.2.2.3.2.2.1		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	

2.2.2.3.2.2.1.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.2.2.2		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.2.2.2.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.3.2.2.3		BuyInIdentification	BuyInId	[1..1]	Max35Text	Indicates the reference id of the buy in.	Número da recompra.	
2.2.2.3.2.2.4		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.3.2.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.5		SettlementDate	SttlmDt	[0..1]	+	Provides the close out date of the buy in position.	Fornece a data de encerramento da posição de recompra.	
2.2.2.3.2.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.2.6		Side	Sd	[1..1]	Side1Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	

2.2.2.3.2.2.7		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account. .	Identificação da carteira na depositária.	
2.2.2.3.2.2.8		OriginalQuantity	OrgnlQty	[1..1]	+	Provides original quantity information.	Quantidade original.	
2.2.2.3.2.2.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.9		CancelledQuantity	CancQty	[0..1]	+	Provides cancelled quantity information.	Quantidade cancelada.	
2.2.2.3.2.2.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.10		ExecutedQuantity	ExctdQty	[0..1]	+	Provides executed quantity information.	Quantidade executada.	
2.2.2.3.2.2.10.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.11		RevertedQuantity	RvrdQty	[0..1]	+	Provides reverted quantity information.	Quantidade revertida.	
2.2.2.3.2.2.11.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.2.2.12		OriginalValue	OrgnlVal	[1..1]	+	Provides original value information.	Valor original.	
2.2.2.3.2.2.12.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
2.2.2.3.2.2.13		CancelledValue	CancVal	[0..1]	+	Provides cancelled value information.	Valor cancelado.	
2.2.2.3.2.2.13.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
2.2.2.3.2.2.14		ExecutedValue	ExctdVal	[0..1]	+	Provides executed value.	Valor executado.	
2.2.2.3.2.2.14.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	
2.2.2.3.2.2.15		RevertedValue	RvrdVal	[0..1]	+	Provides reverted value information.	Valor revertido.	
2.2.2.3.2.2.15.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	

2.2.2.3.2.2.16		AveragePriceOriginalDelivery	AvrgPricOrgnlDlvry	[0..1]	+	Provides average price of the original delivery information.	Preço médio entrega original.	
2.2.2.3.2.2.16.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
2.2.2.3.2.2.17		ReversionPrice	RvsrnPric	[0..1]	+	Provides reversion price.	Preço da reversão.	
2.2.2.3.2.2.17.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	

bvmf.097.02 – CashMarketPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

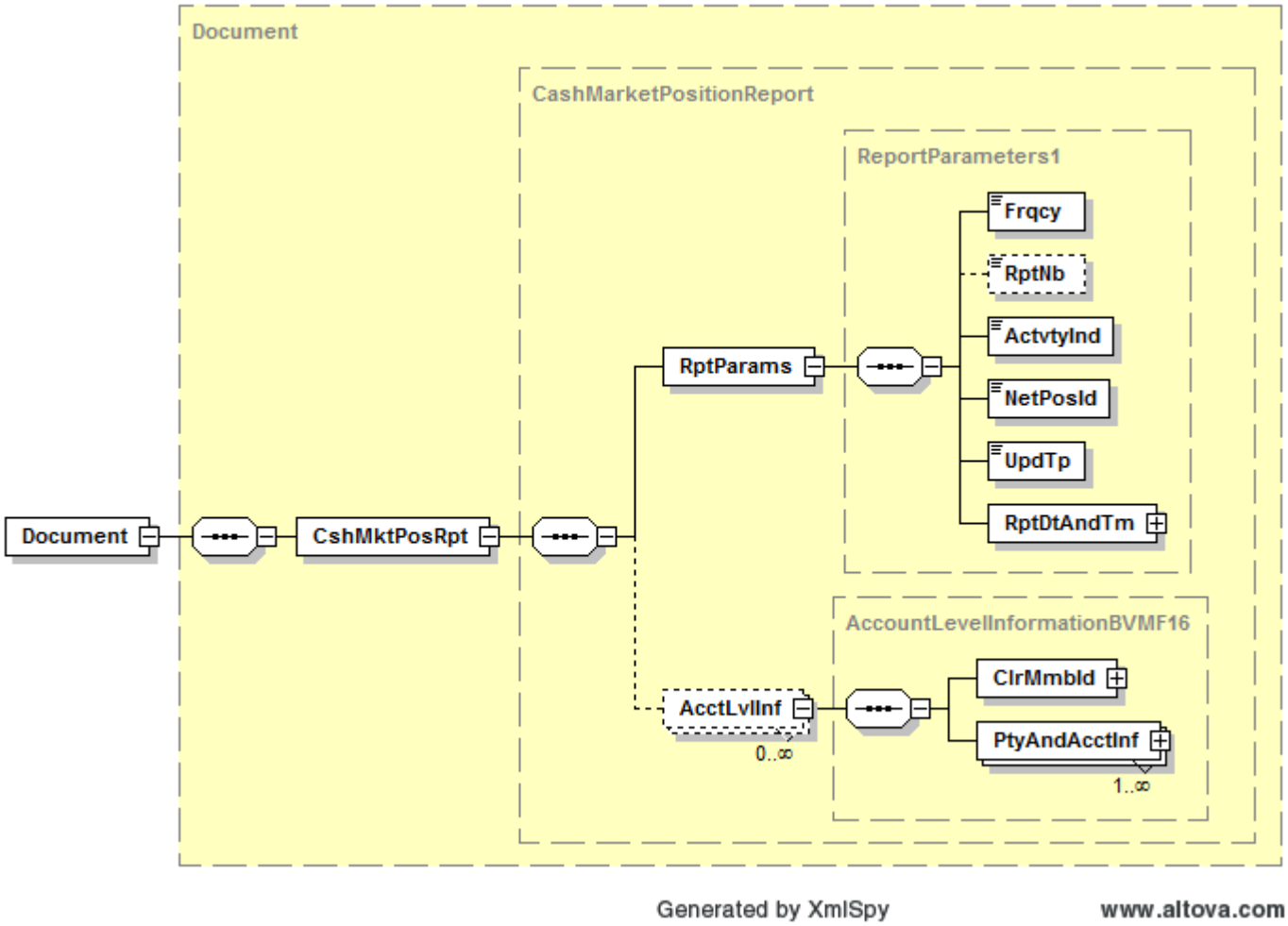
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto no mercado à vista ainda não liquidadas.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes acompanhar as posições em aberto não liquidadas no mercado à vista sob sua responsabilidade.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – A informação de fator de cotação não é disponibilizada para o mercado de ouro.

Estrutura da Mensagem bvmf.097.02 – CashMarketPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information.	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	

2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.2.1		CustodianIdentification	CtdnId	[0..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2		SafekeepingAccountInformation	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safeKeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1		SafekeepingAccountIdentification	SfkpgAcctId	[0..1]	+	Provides safeKeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.2		CashMarketPositionInformation	CshMktPosInf	[1..*]	+	This block provides Cash Market position information.	Este bloco fornece informações da posição do mercado a vista.	
2.2.2.2.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	

2.2.2.2.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2.2.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	

2.2.2.2.2.2.2.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.2.2.2.2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.2.2.2.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.2.2.3.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	

2.2.2.2.2.2.3.2		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.2.2.2.3.3		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	R1
2.2.2.2.2.2.4		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the trade date	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.2.2.2.5		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	ISODate	Provides settlement date.	Informa a data de liquidação.	
2.2.2.2.2.2.6		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Identification of the sub account.	Identificação da carteira na depositária.	
2.2.2.2.2.2.7		LongQuantity	LngQty	[0..1]	DecimalNumber	Long quantity.	Quantidade comprada.	
2.2.2.2.2.2.8		LongAveragePrice	LngAvrgPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average long price.	Preço médio de compra.	
2.2.2.2.2.2.9		LongGrossTradeAmount	LngGrssTradAmt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the long total amount.	Referencia o volume total de compra.	

2.2.2.2.2.2.10		ShortQuantity	ShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Short quantity.	Quantidade vendida.	
2.2.2.2.2.2.11		ShortAveragePrice	ShrtAvrgPric	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Average short price.	Preço Médio de Venda.	
2.2.2.2.2.2.12		ShortGrossTradeAmount	ShrtGrssTradAmt	[0..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	It references the short total amount.	Referencia o volume total de venda.	
2.2.2.2.2.2.13		CoveredShortQuantity	CvrdShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Covered short position.	Posição vendida coberta.	
2.2.2.2.2.2.14		UncoveredShortQuantity	UcvrdShrtQty	[0..1]	DecimalNumber	Not covered short position.	Posição vendida descoberta.	

bvmf.098.02 – NonFungibleDerivativesPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

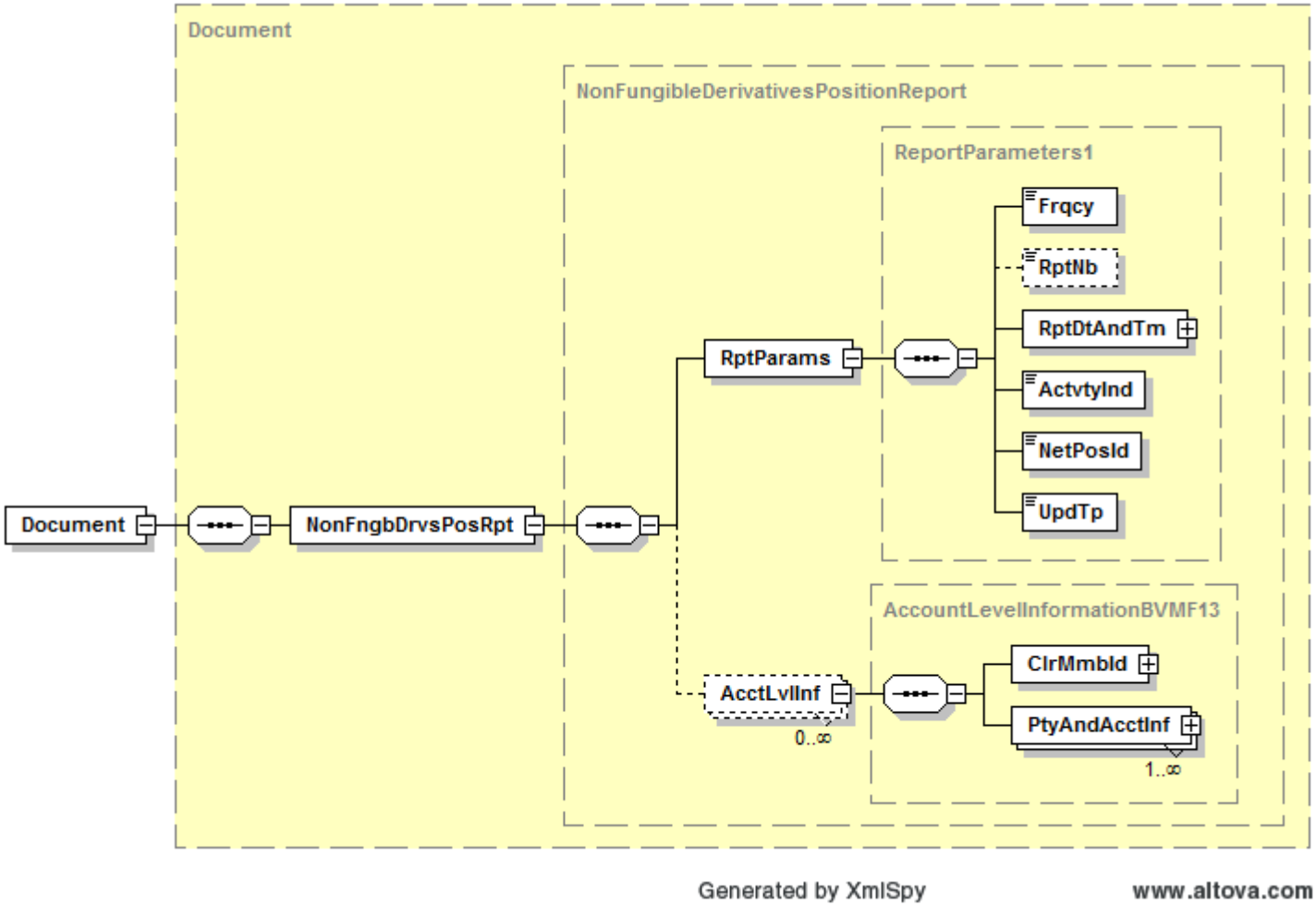
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição em aberto nos mercados de derivativos não fungíveis, basicamente, termo de ouro e de ações.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e Custodiantes, se indicados, acompanhar as posições de derivativos não fungíveis sob sua responsabilidade.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O número do contrato não é disponibilizado para negócios do dia, somente a partir de D+1.

Regra 2 – Somente para termo de ouro.

Regra 3 – Somente para termo de ações.

Estrutura da Mensagem bvmf.098.02 – NonFungibleDerivativesPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Fornece parâmetros usados na geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	

1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides Account Level Information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information	Informações do Membro de Compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..*]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account identification.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		NonFungibleDerivativesPositionInformation	NonFngbDrvsPosInf	[1..*]	+	This block provides Non Fungible Derivatives position information.	Este bloco fornece informações das posições de derivativos não fungíveis.	
2.2.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification.	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
2.2.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	

2.2.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.2.2.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de	

							controle	
2.2.2.2.2.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.2.3		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo	

							70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.2.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.2.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	R2
2.2.2.2.4		UnderlyingSecurityIdentification	UndrlygSctyId	[0..1]	+	This block contains underlying ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN subjacente.	

2.2.2.2.4.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.2.5		UnderlyingInstrumentAttributes	UndrlygInstrmAttrbts	[1..1]	+	This block has the identification underlying instrument attributes.	Este bloco possui a identificação de elementos que caracterizam um intrumento subjacente.	
2.2.2.2.5.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.2.6		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	

2.2.2.2.7		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	ISODate	Provides Settlement Date (Expired date)	Data de Vencimento.	
2.2.2.2.8		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	Provides Trade Information.	Informações de Negociação.	
2.2.2.2.8.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
2.2.2.2.8.2		ContractNumber	CtrctNb	[0..1]	int	Contract number.	Número do contrato.	R1
2.2.2.2.9		Side	Sd	[1..1]	Side1Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
2.2.2.2.10		Quantity	Qty	[1..1]	DecimalNumber	Provides the number of traded contracts.	Informações da quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.2.11		OriginalQuantity	OrgnlQty	[1..1]	DecimalNumber	Provides original quantity information.	Quantidade original.	R3
2.2.2.2.12		CashMarketTradeQuantity	CshMktTradQty	[0..1]	DecimalNumber	Provides quantity with cash market trade information.	Quantidade de posição com cobertura a ser efetuada com ativo à vista.	R3
2.2.2.2.13		EarlySettlementQuantity	EarlySttlmQty	[0..1]	DecimalNumber	Quantity of assets to be early settled.	Quantidade de ativos a serem liquidados antecipadamente.	R3
2.2.2.2.14		CoverageDeliveryFailureQuantity	CvrgDlvryFailrQty	[0..1]	DecimalNumber	Coverage quantity with delivery failure.	Quantidade de posição a ser coberta com falha de entrega de ativos.	R3
2.2.2.2.15		CoverageBuyInPositionQuantity	CvrgBuyInPosQty	[0..1]	DecimalNumber	Coverage quantity with buy-in position.	Quantidade de posição a ser coberta com recompra de ativos.	R3
2.2.2.2.16		CoveredQuantity	CvrdQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the covered quantity.	Informa a quantidade coberta.	R3
2.2.2.2.17		UncoveredQuantity	UcvrdQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the uncovered quantity.	Informa a quantidade descoberta.	R3
2.2.2.2.18		ForwardPrice	FwdPric	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Price of the forward contract.	Preço do contrato a termo.	
2.2.2.2.19		PositionValue	PosVal	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Position Value.	Valor da posição.	
2.2.2.2.20		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	R3
2.2.2.2.20.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

2.2.2.2.20.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.20.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.20.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.20.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.20.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.2.20.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.2.20.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.21		CounterPartyIdentification	CntrPtyId	[1..1]	+	This block contains counterparty identification.	Este bloco contém a identificação da contraparte.	
2.2.2.2.21.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.21.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.21.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.21.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

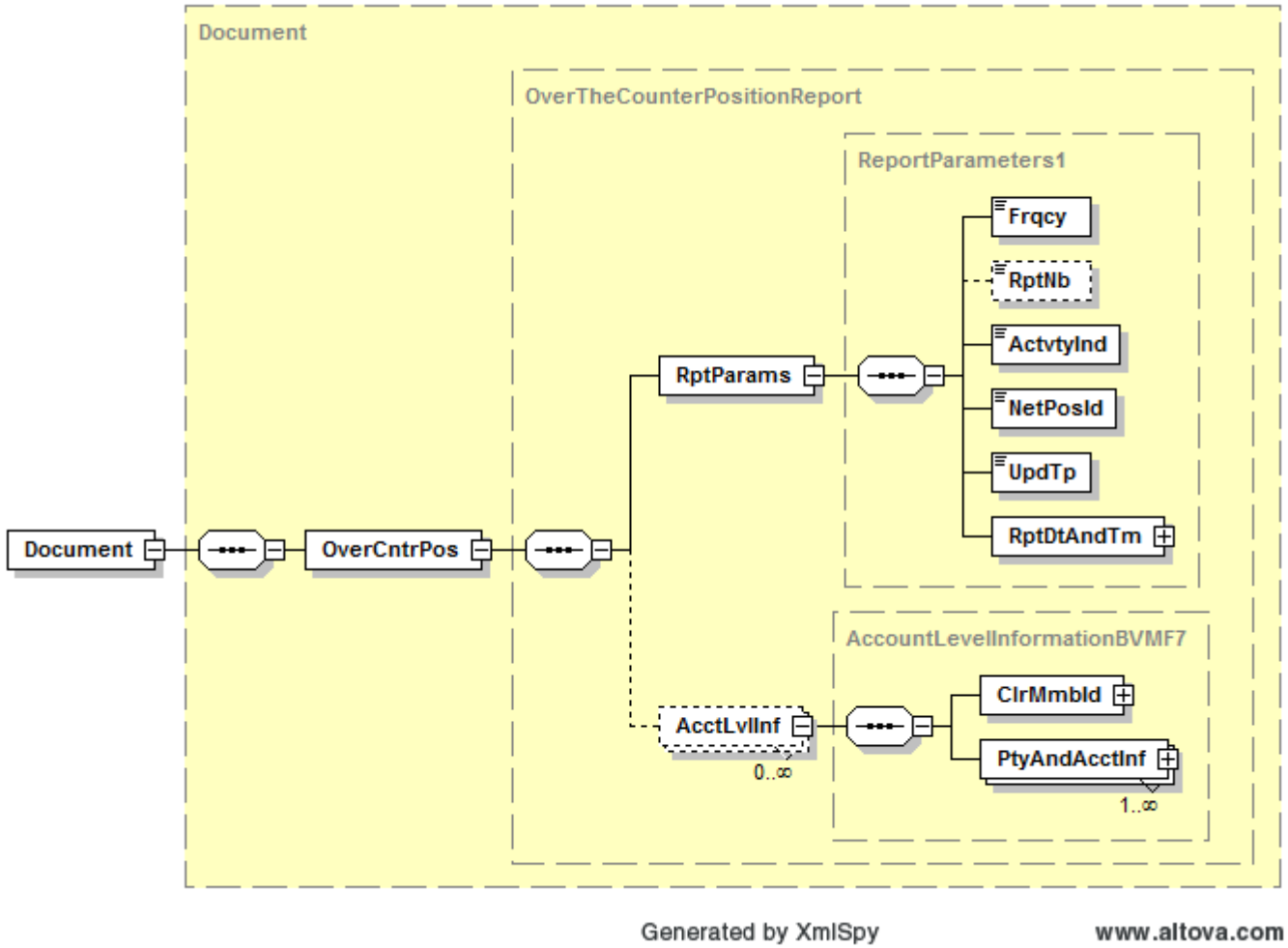
Esta mensagem traz as informações de posição em aberto nos mercados de derivativos de balcão com característica de contraparte central garantidora.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs e MCs acompanhar as posições em aberto de derivativos balcão sob sua responsabilidade. São disponibilizadas as informações básicas das posições de balcão, detalhes destas posições devem ser obtidos no sistema de registro de mercado de balcão.

No caso de contratos de balcão com garantia parcial, é disponibilizado no sistema apenas informações da parte que tem a responsabilidade de depósito de colaterais.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – O MC não tem informação do nome do cliente final da corretora.

Estrutura da Mensagem bvmf.099.01 – OverTheCounterPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the net position.	Parâmetros relacionados com a posição líquida.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default “true”.	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão “true”.	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX" .	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date and time of the report.	Data e hora do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides account level information.	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIde	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	

		ntification						
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuida a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndActInf	[1..*]	+	This block identifies the party (TP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party details identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVMF. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	R1
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.2.2.3		OverTheCounterInformation	OverTheCntrInf	[1..*]	+	This block provides the Over The Counter position information	Este bloco fornece informações sobre posição de OTC.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	

2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8 (Security source)	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source)	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		ContractDetails	CtrctDtls	[1..1]	+	Displays details about a contract, such as identification, date, etc. codes.	Apresenta detalhes a respeito de um contrato, como sua identificação, data, codigos etc.	
2.2.2.3.2.1		ContractType	CtrctTp	[1..1]	ExternalContractTypeCode	Contract typeE.g: Swap This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternaContractTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de contrato. Ex: Swap Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalContractTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.3.2.2		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	Information about trade.	Informações sobre a negociação.	
2.2.2.3.2.2.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract Number.	Número do contrato.	
2.2.2.3.2.3		ContractCode	CtrctCd	[1..1]	Max5Text	Code that identifies an OTC contract type. E.g.: SCE; SCL; SCP; SDC; others	Código que identifica um contrato de OTC.Ex: SCE; SCL; SCP; SDC.	
2.2.2.3.2.4		RegistrationDate	RegnDt	[1..1]	+	Date when the contract has been registered in the OTC System	Data em que o contrato foi registrado no sistema de balcão.	
2.2.2.3.2.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.2.5		StartDate	StartDt	[1..1]	+	Date when the contract starts to be valued	Data de Inicio de Valorização.	
2.2.2.3.2.5.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	

2.2.2.3.2.6		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	+	Date when the contract expires	Data em que se expira o contrato.	
2.2.2.3.2.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.3		BuyInstrumentCode	BuyInstrmCd	[0..1]	+	The instrument Code that represents the buy side. For swap is mandatory and for forward and flexible options, this field will be filled in only when the trade is a buy.	Código de instrumento da ponta de compra. Para swap este campo é sempre informado, para termos e as opções flexíveis, este campo será preenchido somente quando a natureza da posição for comprada.	
2.2.2.3.3.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.4		SellInstrumentCode	SellInstrmCd	[0..1]	+	The instrument Code that represents the sell side. For swap is mandatory and for forward and flexible options, this field will be filled in only when the trade is a sell.	Código de instrumento da ponta de venda. Para swap este campo é sempre informado, para termos e as opções flexíveis, este campo será preenchido somente quando a natureza da posição for vendida.	
2.2.2.3.4.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.5		RegisteredVolume	RegdVol	[1..1]	+	Registered volume.	Volume registrado.	
2.2.2.3.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Amount of money in the cash entry.	Valor em moeda.	

bvmf.034.01 – SecuritiesLendingPositionReport

Funcionalidade da Mensagem

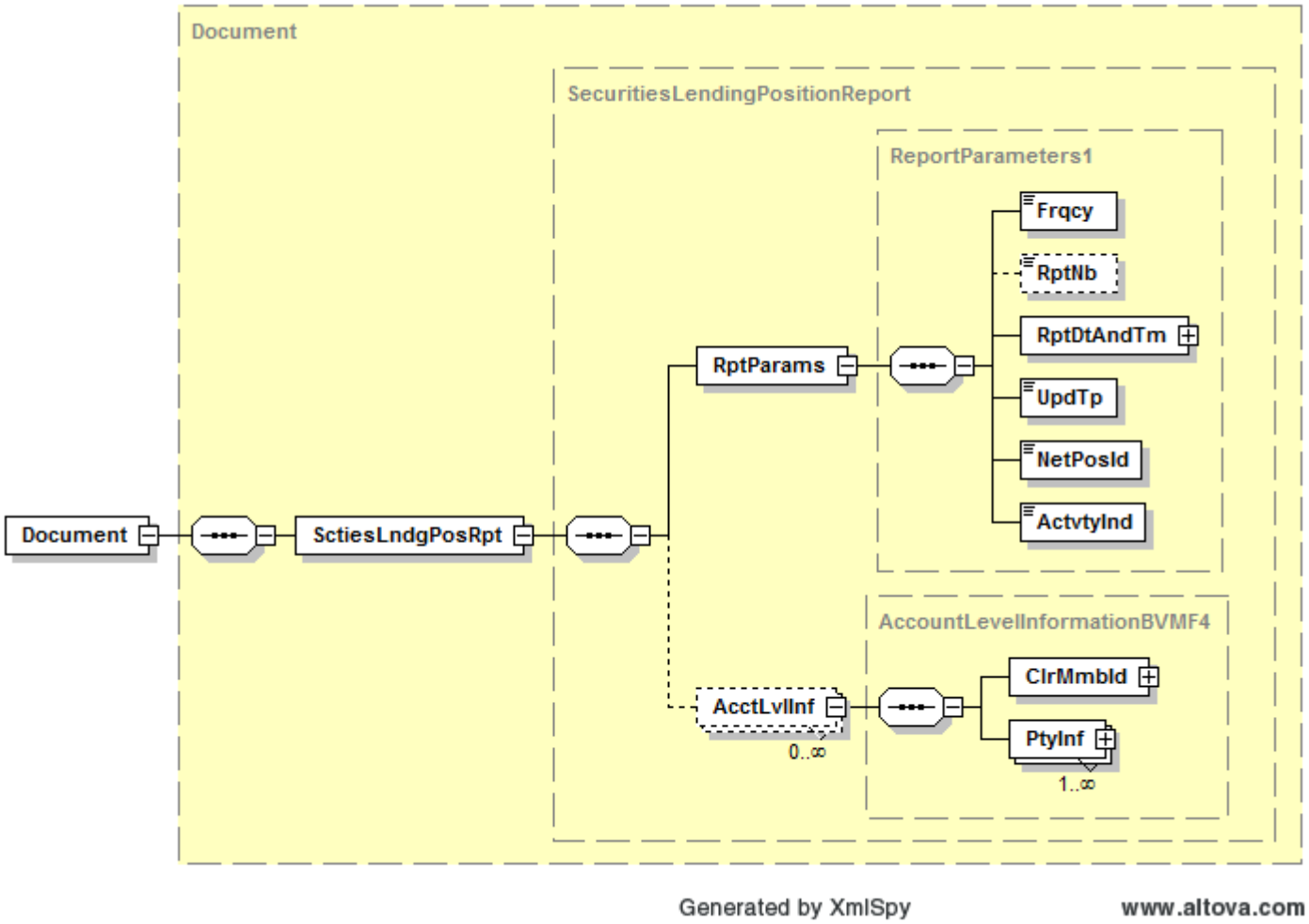
Escopo

Esta mensagem traz as informações de posição de aluguel de ativos.

Uso

Essa mensagem permite a PNPs, PLs, MCs e CSTs acompanhar as posições de alguel de ativos sob sua responsabilidade.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1- Deve ser preenchido somente quando for enviado para Participante e Custodiante Doador.
R2 - Deve ser preenchido somente quando for enviado para Participante Doador.
R3 - Deve ser preenchido somente quando for enviado para Participante Doador e Tomador.
R4 - Deve ser preenchido somente quando for enviado para Participante Tomador.
R5 - Deve ser preenchido somente quando for enviado para Participante e Custodiante Tomador.
R6 - Preenchido somente no caso de AnonymityIndicator Indicator seja igual a "false".

Estrutura da Mensagem bvmf.034.01 – SecuritiesLendingPositionReport

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Provides the report parameters.	Fornece parâmetros usados na geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	

1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[0..*]	+	Provides Account Level Information	Informação da posição do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informações do Membro de Compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyInformation	PtyInf	[1..*]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides Party Identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações sobre a conta do participante.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.2.1		CustodianIdentification	CtdnId	[1..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2		SafekeepingAccountInformation	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	

2.2.2.2.2.1		SafekeepingAccount Identification	SfkpgAcctId	[1..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.2		SecuritiesLendingPosition	SctiesLndgPos	[1..*]	+	This block describle the Securities Lending Position.	Este bloco contém informações da posição de aluguel de ativos.	
2.2.2.2.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.2.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	

2.2.2.2.2.2.2		PlaceOfTrade	PlcOfTrad	[1..1]	+	Place at which the security is traded.	Este bloco identifica o ambiente de negociação onde o negócio foi executado. Este bloco é utilizado plea BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	
2.2.2.2.2.2.2.1		Type	Tp	[1..1]	+	This block is not used by BM&FBOVESPA. See “Code” field in the default value of this field.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	
2.2.2.2.2.2.2.1 .1		Code	Cd	[1..1]	MarketType2Code	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o default = EXCH.	
2.2.2.2.2.3		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the date and time of trade transaction.	Fornece data e hora do pregão.	
2.2.2.2.2.4		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do pré-contrato.	
2.2.2.2.2.5		OfferingNumber	OfferngNb	[1..1]	Number	It indicates the original offering code.	Código da oferta.	
2.2.2.2.2.6		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
2.2.2.2.2.7		SecuritiesFinancingTradePreviousIdentification	SctiesFincgTradPrvsId	[0..1]	Max35Text	Previous contract number.	Identificação do contrato anterior de aluguel de ativos (contrato que originou a renovação).	
2.2.2.2.2.8		SideLenderBorrower	SdLndrBrrwr	[1..1]	ExternalSideLenderBorrowerCode	Side lender or borrower of position. This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalSideLenderBorrowerCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Lado tomador ou doador da posição. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSideLenderBorrowerCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.9		UnderlyingFinancialInstrumentIdentification	UndrlygFinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.2.2.9.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.9.1 .1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.9.1		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	

.2								
2.2.2.2.2.2.9.1 .2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.2.9.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.2.9.2 .1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2.10		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Caracterísitca do instrumento financeiro subjacente.	

2.2.2.2.2.2.10.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle.	
2.2.2.2.2.2.10.2		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	

2.2.2.2.2.2.10.3		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	Represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.2.2.11		UnderlyingSecurityId	UndrlygSc	[1..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contem informações de código	

		entification	tyId				de negociação.	
2.2.2.2.2.2.11.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
2.2.2.2.2.2.12		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	ISODate	Expiration date of the contract.	Data de vencimento do contrato.	
2.2.2.2.2.2.13		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[1..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	
2.2.2.2.2.2.14		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
2.2.2.2.2.2.15		PreviousDayClosingPrice	PrvsDayClsgPric	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Previous day´s closing price.	Preço de fechamento do dia anterior.	
2.2.2.2.2.2.16		CurrentFactor	CurFctr	[1..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	
2.2.2.2.2.2.17		InitialQuantity	InitlQty	[1..1]	DecimalNumber	Initial quantity of the contract.	Quantidade inicial do contrato.	
2.2.2.2.2.2.18		WaitingSettlementQuantity	WtgSttlmQty	[0..1]	DecimalNumber	Waiting settlement quantity.	Quantidade em liquidação.	
2.2.2.2.2.2.19		SettledQuantity	SttldQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Total quantity of securities that were settled.	Quantidade total de títulos liquidados.	
2.2.2.2.2.2.20		CoveredQuantity	CvrdQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the covered quantity.	Informa a quantidade coberta.	
2.2.2.2.2.2.21		UncoveredQuantity	UcvrdQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the uncovered quantity.	Informa a quantidade descoberta.	
2.2.2.2.2.2.22		RenewalQuantity	RenwQty	[0..1]	DecimalNumber	Quantity contract renewal.	Quantidade renovada do contrato.	
2.2.2.2.2.2.23		CurrentQuantity	CurQty	[1..1]	DecimalNumber	Current quantity of the contract.	Quantidade atual do contrato.	
2.2.2.2.2.2.24		CurrentVolumeContract	CurVolCtrct	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Current Volume Contract	Volume atual do contrato.	

2.2.2.2.2.25		PaymentType	PmtTp	[1..1]	ExternalPaymentTypeCode	Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPaymentTypeCode the file ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls.	Este atributo identifica a forma de liquidação do negócio. EX: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_FASE2.xls	
2.2.2.2.2.26		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente pelo doador.	
2.2.2.2.2.27		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente pelo doador em caso de OPA.	
2.2.2.2.2.28		LenderRate	LndrRate	[0..1]	+	Lender contract rate.	Taxa do doador do contrato.	R1
2.2.2.2.2.28.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
2.2.2.2.2.29		LenderBrokerCommission	LndrBrkrComssn	[0..1]	+	Lender contract commission.	Comissão do doador do contrato.	R2
2.2.2.2.2.29.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
2.2.2.2.2.30		BorrowerRate	BrrwrRate	[0..1]	+	Borrower contract rate, composed by the sum of the lender´s rate and commission.	Taxa do tomador do contrato, composta pela soma da taxa e comissão do doador.	R3
2.2.2.2.2.30.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
2.2.2.2.2.31		BorrowerBrokerCommission	BrrwrBrkrComssn	[0..1]	+	Borrower contract commission.	Comissão do tomador do contrato.	R4
2.2.2.2.2.31.		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	

1								
2.2.2.2.2.32		BorrowerFinalRate	BrrwrFnlRate	[0..1]	+	Final Rate = Lender rate + lender broker commission + borrower broker commission.	Taxa Tomador Final. Composta pela soma da Taxa Doador, Comissão Doadora e Comissão Tomadora.	R5
2.2.2.2.2.32.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
2.2.2.2.2.33		TakeUpPartyInformation	TakeUpPtyInf	[0..1]	+	Provides details about the take up party identification and account.	Fornece detalhes da identificação do participante destino da indicação e da conta.	
2.2.2.2.2.33.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.2.2.2.33.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.33.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.2.33.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.2.33.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE	

						field should be filled with default value = 39.	BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2.33.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.2.2.33.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.33.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.34		AnonymityIndicator	AnmtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Anonymous contract indicator.	Indicador de contrato anônimo.	
2.2.2.2.2.35		CounterPartyIdentification	CntrPtyId	[0..1]	+	This block contains counterparty identification.	Este bloco contém a identificação da contraparte.	R6
2.2.2.2.2.35.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.35.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.35.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.2.35.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

2.2.2.2.2.36		CounterPartyInterestOwnCapitalTaxIndicator	CntrPtyIntrstOwnCptlTaxInd	[1..1]	YesNoIndicator	The field gives the tax status of the counterparty to the securities lending contract, for purposes of the collection of Income Tax resulting from payment of interest on shareholders' equity (law 13.043/14).	O atributo informa a natureza tributária da contraparte do contrato de aluguel de ativos para fins de recolhimento de Imposto de Renda em decorrência de pagamento de juros sobre capital próprio (lei 13.043/14). O atributo indicará se a contraparte é ou não tributada.	
2.2.2.2.2.37		CounterPartyIncomeTaxIndicator	CntrPtyIncmTaxInd	[1..1]	YesNoIndicator	The field gives the tax status of the counterparty to the securities lending contract, for purposes of the collection of Income Tax resulting from the payment of proceeds (law 13.043/14).	O atributo informa a natureza tributária da contraparte do contrato de aluguel de ativos para fins de recolhimento de Imposto de Renda em decorrência de pagamento de rendimento (lei 13.043/14). O atributo indicará se a contraparte é ou não tributada.	
2.2.2.2.2.38		SecuritiesLendingType	SctiesLndgTp	[1..1]	ExternalSecuritiesLendingTypeCode	Securities lending type. This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalSecuritiesLendingTypeCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Tipo de contrato de aluguel de ativos. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecuritiesLendingTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.39		NetResultIdentification	NetRsltId	[0..1]	Max35Text	Unique Identifier for the Net Result.	Identificador único para o Resultado Líquido.	R5

BVBG.016.01 – Arquivo de Movimentação de Posição de Derivativos ("DerivativesPositionMovement")

Funcionalidade do Arquivo

Escopo

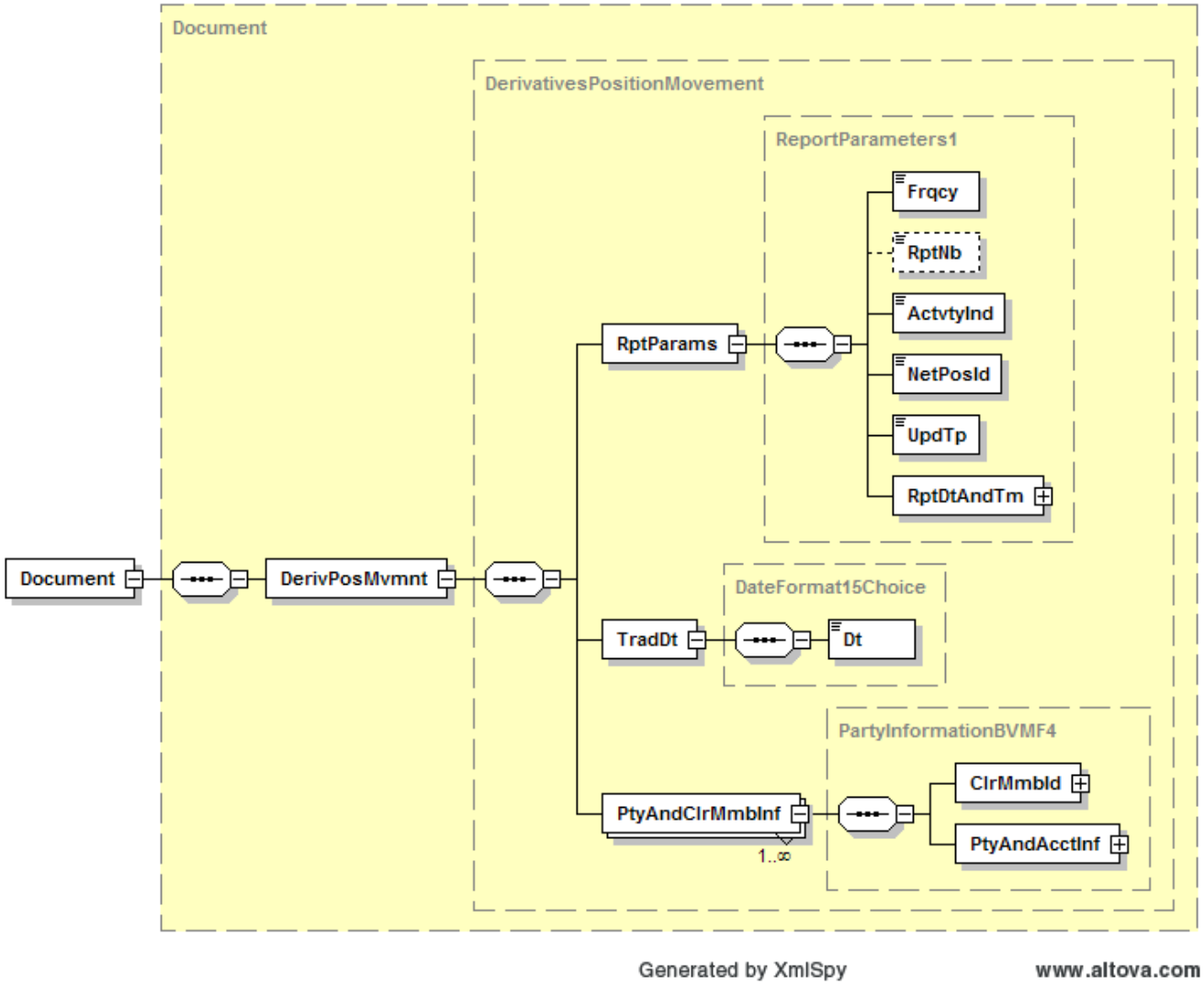
Arquivo gerado para PNPs e PLs, no final de cada data de movimento, com detalhes dos negócios efetuados nos mercados de derivativos fungíveis da BM&FBOVESPA. Esse arquivo é composto pela mensagem (bvmf.025.01).

Uso

Esse arquivo permite ao participante verificar os detalhes dos negócios realizados no mercado de derivativos fungíveis.

Diagrama da Mensagem bvmf.025.01

O arquivo “DerivativesPositionMovement” (BVBG.016.01) é composto pela mensagem bvmf.025.01.


Document
DerivativesPositionMovement
ReportParameters1
Frqcy
RptNb
ActvtyInd
NetPosId
UpdTp
RptDtAndTm
RptParams
Document
DerivPosMvmnt
DateFormat15Choice
TradDt
Dt
PartyInformationBVMF4
ClrMmbId
PtyAndClrMmbInf
PtyAndAcctInf
1..∞
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

Regra 1 – Não aplicável para opções sobre ações.

Regra 2 - Os campos abaixo somente terão informação quando da inclusão de opções sobre ação no Controle de Posição:

- Distribuição da opção;
- ISIN do ativo objeto;
- Distribuição do ativo objeto;
- Indicador tipo de série; e
- Fator de cotação.

Regra 3 – Aplicável somente para opções.

Estrutura da Mensagem bvmf.025.01 – DerivativesPositionMovement

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[0..1]	+	Parameters related to the report	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency 6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	

1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão .	
2.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.0		PartyAndClearingMemberInformation	PtyAndClrMmbInf	[1..*]	+	Provides Party and Clearing Member Information	Informações do Participante e do Membro de Compensação.	
3.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information	Informações do membro de compensação.	
3.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
3.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndAcctInf	[1..1]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta .	
3.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
3.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

						The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2.2		AccountAndInstrumentInformation	AcctAndInstrmInf	[1..*]	+	Provides Account and Instrument Information.	Informações da Conta do Participante e do Instrumento.	
3.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification	Fornece dados de identificação da conta.	
3.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.2.2.2		InstrumentInformation	InstrmInf	[1..*]	+	Provides Instrument Information	Informações do instrumento.	
3.2.2.2.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
3.2.2.2.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
3.2.2.2.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
3.2.2.2.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	

3.2.2.2.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.2.2.2.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
3.2.2.2.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
3.2.2.2.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

3.2.2.2.2.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
3.2.2.2.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

3.2.2.2.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.2.2.2.3.2		RoundLotContract Size	RndLotCtrct Sz	[1..1]	DecimalNumber	For options on equities= Round lot For financial and comoditties derivatives = Contract multiplier Definition Round lot: Multiple and minimum quantity of securities that can be purchased or sold. Definiiton Contract size: Ratio or multiplying factor used to convert the contract quotation to the contract size	Para opções sobre equities = Lote padrão. Para derivativos de comoditties e financeiros= Multiplicador do contrato Definição de Lote padrão: Quantidade mínima e múltiplia de papéis que pode ser adquirida ou vendida. Definição de tamanho do contrato: Relação ou fator de multiplicação utilizado para converter a cotação do contrato no tamanho do contrato.	
3.2.2.2.3.3		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	

3.2.2.2.3.4		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	R1
3.2.2.2.3.5		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	R2
3.2.2.2.3.6		OptionType	OptnTp	[0..1]	+	Specifies whether it is a Call option (right to purchase a specific underlying asset) or a Put option (right to sell a specific underlying asset).	Este bloco identifica se o estilo da opção é opção de compra (direito de comprar um ativo específico subjacente) ou opção de venda (direito de vender um ativo específico subjacente).	R3
3.2.2.2.3.6.1		Code	Cd	[1..1]	OptionType1Code	Option type expressed as an ISO 20022 code. The valid codes are CALL and PUTT.	Tipos de Opções expressas como na ISO 20022. Os valores válidos são:CALL and PUTT	
3.2.2.2.3.7		OptionDistributionIdentification	OptnDstrbtnId	[0..1]	int	Distribution number of the option.	Número de distribuição da opção.	R2

3.2.2.2.3.8		UnderlyingInstrument	UndrlygInstrm	[0..1]	Max12Text	Underlying Security Identifier International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	Identificador do instrumento subjacente. INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	R2
3.2.2.2.3.9		DistributionIdentification	DstrbtnId	[0..1]	int	Option's underlying asset distribution code	Número da distribuição do ativo objeto da opção.	R2
3.2.2.2.3.10		ExercisePrice	ExrcPric	[0..1]	+	Predetermined price at which the holder of a derivative will buy or sell the underlying instrument.	Preço pré-determinado em que o titular de um derivativo vai comprar ou vender um instrumento subjacente.	R3
3.2.2.2.3.10.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Exercise price	Preço de exercício	
3.2.2.2.3.11		OptionStyle	OptnStyle	[0..1]	+	Specifies how an option can be exercised (American, European)	Informa como a opção pode ser exercida. Ex:	R3

							Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento.	
3.2.2.2.3.11.1		Code	Cd	[1..1]	OptionStyle2Code	Option style expressed as an ISO 20022 code.	Informa como a opção pode ser exercida. Ex: Européia: Opção que só será exercida na data do vencimento. Americana: Opção que pode ser exercida em qualquer data a partir da emissão até o vencimento. Valores Válidos AMER ou EURO.	
3.2.2.2.3.12		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	+	Provides Expiration date	Data de vencimento.	
3.2.2.2.3.12.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
3.2.2.2.4		TradeDetails	TradDtls	[1..*]	+	Provides the trade details.	Fornece os detalhes do negócio.	
3.2.2.2.4.1		Side	Sd	[1..1]	Side1Code	Coded list to specify the side of the trade.The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
3.2.2.2.4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do negócio.	
3.2.2.2.4.3		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Provides Allocation Information.	Informação sobre a alocação.	
3.2.2.2.4.3.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	
3.2.2.2.4.4		Quotation	Qtn	[1..1]	+	Trade price	Preço do negócio.	
3.2.2.2.4.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Trade price	Preço do negócio.	
3.2.2.2.4.5		UnitPrice	UnitPric	[0..1]	+	Trade price converted to unit price, only applicable for interest rate instruments.	Preço de negócio convertido em preço unitário, aplicável apenas para instrumentos de taxa de juros.	
3.2.2.2.4.5.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistori	Unit price.	Preço unitário	

					cCurrencyAnd2DecimalAmount			
3.2.2.2.4.6		TradeTransactionType	TradTxTp	[1..1]	ExternalTradeTransactionTypeCode	Trade type code. This filed requires an externalcodelist. These codes and values were made in external sheets to allow the flexible maintenance according to the update requirements at BM&FBOVESPA. In this case, the external is ExternalTradeTransactionTypeCode on the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. E.g 0 Regular Trade 29 Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade	Código do tipo de negócio. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTradeTransactionTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls Ex: 0 Regular Trade 29 (Exercise Complement 38 Block Trade (BTF) 45 Options Exercise 56 Opening Trade.	
3.2.2.2.4.7		TradeStrategy	TradStrtgy	[0..1]	+	Strategy code. Only applicable when the position comes from a strategy trade.	Código da estratégia. Aplicável somente quando a posição é proveniente de uma estratégia.	
3.2.2.2.4.7.1		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, etc.	Ativo associado ao papel., tal como DOL BGI OZ1, WDL, CNI, etc.	
3.2.2.2.4.8		AllocatedQuantity	AllctdQty	[1..1]	+	Allocated quantity	Quantidade Alocada (quantidade do negócio alocado para o investidor)	
3.2.2.2.4.8.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.2.2.2.4.9		NettedQuantity	NetdQty	[1..1]	+	Netted quantity	Quantidade alocada que foi encerrada por compensação .	
3.2.2.2.4.9.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.2.2.2.4.10		NonNettedQuantity	NonNetdQty	[1..1]	+	Non netted quantity	Quantidade alocada que não foi encerrada por compensação.	
3.2.2.2.4.10.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.2.2.2.4.11		VariationMarginNetted	VartnMrgnNetd	[0..2]	+	Variation margin generated by the netted quantity	Ajuste diário da ponta compensada.	
3.2.2.2.4.11.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin	Ajuste diário	
3.2.2.2.4.11.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a	Crédito ou débito.	

						debit.		
3.2.2.2.4.12		VariationMarginNonNetted	VartnMrgnNonNetd	[0..2]	+	Variation margin generated by the non netted quantity	Ajuste diário da ponta não compensada.	
3.2.2.2.4.12.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Variation margin.	Ajuste diário.	
3.2.2.2.4.12.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
3.2.2.2.4.13		InitialValue	InitlVal	[0..1]	+	Initial value of the dollar swap contract	Valor inicial do contrato de swap cambial com ajuste.	
3.2.2.2.4.13.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Initial value.	Valor inicial.	
3.2.2.2.4.14		PremiumNetted	PrmNetd	[0..2]	+	Premium generated by the netted quantity	Prêmio da ponta compensada	
3.2.2.2.4.14.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Premium	Prêmio	
3.2.2.2.4.14.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	
3.2.2.2.4.15		PremiumNonNetted	PrmNonNetd	[0..2]	+	Premium generated by the non netted quantity	Prêmio da ponta não compensada.	
3.2.2.2.4.15.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF3ActiveOrHistoricCurrencyAnd2DecimalAmount	Premium.	Prêmio.	
3.2.2.2.4.15.2		CreditDebit	CdtDbt	[1..1]	CreditDebitCode	Indicates whether an entry is a credit or a debit.	Crédito ou débito.	

bvmf.076.01 - StrategyBreakdownRequest

Funcionalidade da Mensagem

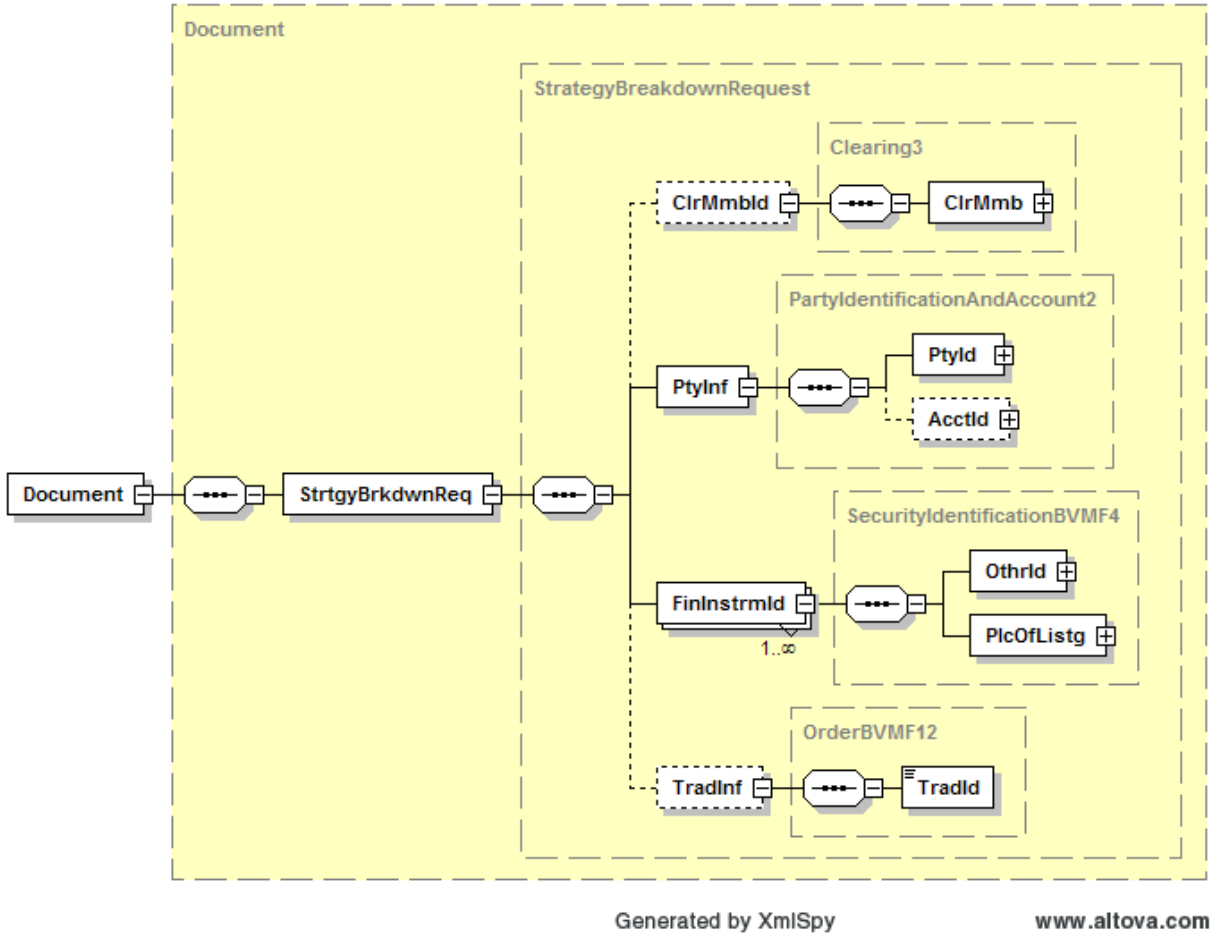
Escopo

O sistema de controle de posições é responsável por efetuar a quebra dos negócios de estratégia realizados no mercado de derivativos financeiros e de commodities. Através desta mensagem os PNPs e PLs podem solicitar de forma intradiária o arquivo com o resultado momentâneo do processo de quebra de estratégias.

Uso

Esta mensagem permite uma série de filtros para atender as necessidades específicas do participante. O instrumento é um atributo mandatório, porém pode se filtrar a conta e o número de negócio.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – A informação do instrumento de estratégia que está sendo consultado deve ser provida informando-se os três atributos que identificam o instrumento dentro da Câmara, ou seja, *Exchange ID, Security Source e Security ID.*

Estrutura da Mensagem bvmf.076.01 – StrategyBreakdownRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[0..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informações do Membro de Compensação.	
1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Party that legally owns the account.	Parte que possui legalmente a conta.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..*]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
3.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	R1
3.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
3.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	R1
3.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
3.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	R1
4.0		TradeInformation	TradInf	[0..1]	+	Information about trade.	Informação sobre o negócio.	
4.1		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	

BVBG.027.01 – StrategyBreakdownResponse

O arquivo “StrategyBreakdownResponse” (BVBG.027.01) é composto pela mensagem (bvmf.77.01)

Funcionalidade da Mensagem

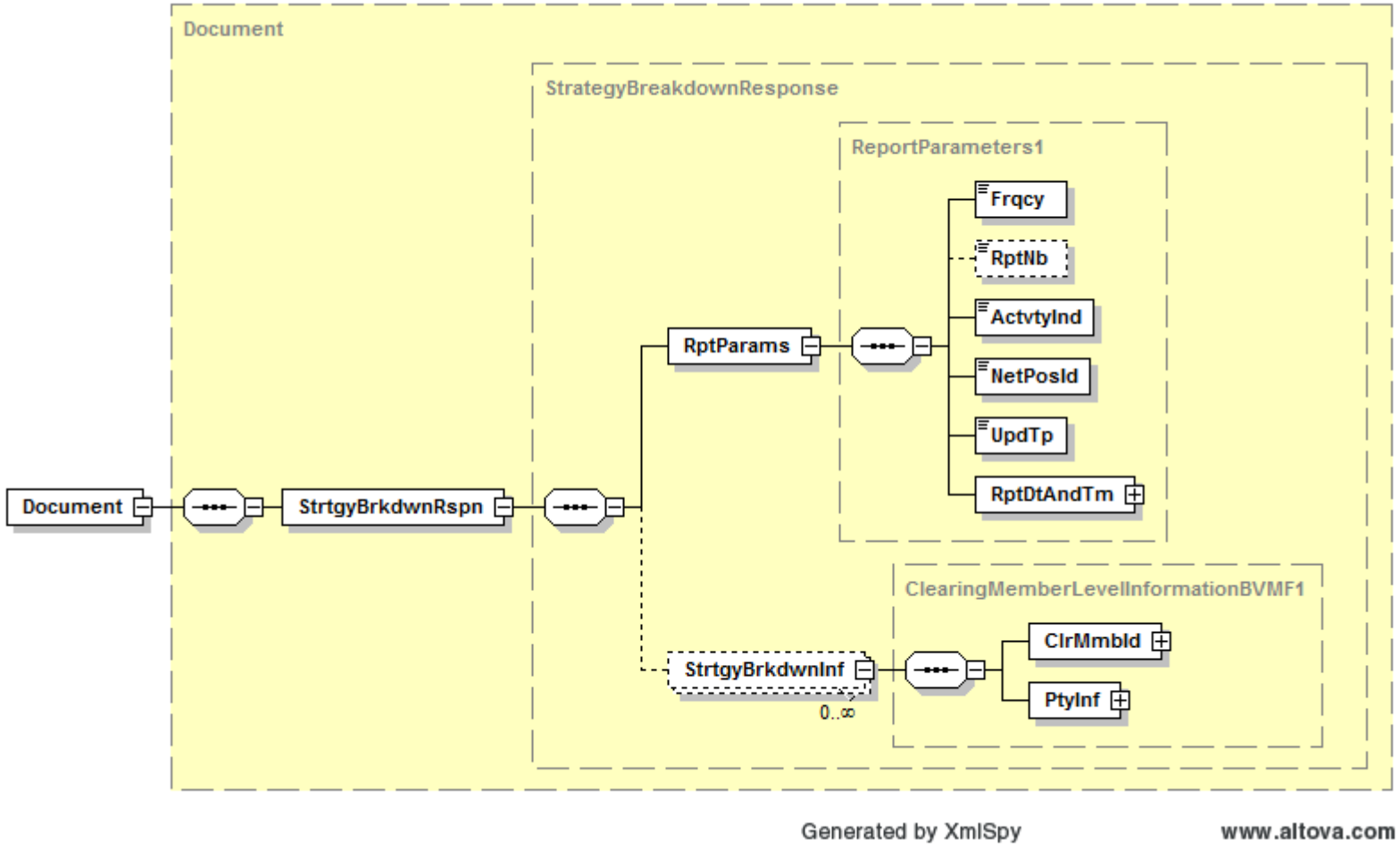
Escopo

O arquivo de quebra de estratégia é gerado sob demanda como resposta da mensagem de solicitação BVMF.076.01, e também é gerado no final de cada data de movimento. Se não houver resultado para a consulta solicitada o arquivo é gerado vazio.

Uso

Este arquivo permite ao participante verificar o resultado do processo de quebra de negócios de estratégia realizados nos mercados de derivativos financeiros e de commodities. O arquivo traz detalhes do instrumento de estratégia, dos negócios realizados em cada instrumento e detalhes das posições geradas em cada contrato base da estratégia.

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

Estrutura da Mensagem bvmf.077.01 – StrategyBreakdownResponse

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Parameters related to the report.	Informações dos parâmetros do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
1.4		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.5		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.6		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Date of the report.	Data do relatório.	
1.6.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
2.0		StrategyBreakdownInformation	StrtgyBrkdwnInf	[0..*]	+	Block with strategy breakdown information	Bloco com informações sobre a quebra de estratégias.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	

2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block identifies the party (PNP, PL) and account.	Este bloco identifica o participante (PNP ou PL) e a Conta.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	

						115 = Account Number	115 = Número da Conta	
2.2.2.2		InvestorName	InvstrNm	[1..1]	+	Provides Investor name.	Informações do nome do investidor.	
2.2.2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Investor short name.	Nome reduzido do investidor.	
2.2.2.3		StrategyInformation	StrtgyInf	[1..*]	+	Block with strategy instrument information.	Bloco com as informações do instrumento de estratégia.	
2.2.2.3.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
2.2.2.3.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.3.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

2.2.2.3.2.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	

2.2.2.3.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.3.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[1..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4		StrategyTradeInformation	StrtgyTradInf	[1..*]	+	Strategy Trade Information	Informações sobre os negócios de estratégia.	

2.2.2.3.4.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	+	Provides the trade date.	Fornece a data da negociação.	
2.2.2.3.4.1.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
2.2.2.3.4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do negócio.	
2.2.2.3.4.3		Allocation	Allcn	[1..1]	+	Allocation information	Informação sobre a alocação.	
2.2.2.3.4.3.1		AllocationIdentification	AllcnId	[1..1]	Max35Text	Identification number of the allocation in the BM&FBOVESPA.	Número de identificação da alocação provido pela BM&FBOVESPA.	
2.2.2.3.4.4		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Strategy trade price.	Preço do negócio de estratégia.	
2.2.2.3.4.4.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Strategy trade price.	Preço do negócio de estratégia.	
2.2.2.3.4.5		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
2.2.2.3.4.6		ConfirmationQuantity	ConfQty	[1..1]	+	Strategy trade quantity.	Quantidade do negócio de estratégia	
2.2.2.3.4.6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.2.2.3.4.7		BreakdownInformation	BrkdwnInf	[1..*]	+	Information related to the positions generated by the strategy trade. Strategy legs.	Informação das posições geradas pelo negócio de estratégia. Pernas da estratégia.	
2.2.2.3.4.7.1		StrategyLegNumber	StrtgyLegNb	[1..1]	int	Strategy Leg Number	Número da perna da estratégia	
2.2.2.3.4.7.2		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides financial instrument identification.	Informação de Identificação do Instrumento Financeiro.	
2.2.2.3.4.7.2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.3.4.7.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.3.4.7.2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.3.4.7.2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.3.4.7.2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está	

							listado.	
2.2.2.3.4.7.2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.3.4.7.3		FinancialInstrumentAttributes	FinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.3.4.7.3.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.3.4.7.3.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	

2.2.2.3.4.7.3.3		ExpirationCode	XprtnCd	[1..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	
2.2.2.3.4.7.4		Side	Sd	[1..1]	Side3Code	Coded list to specify the side of the trade. The valid codes are BUYI and SELL	Código que identifica a natureza da operação do negócio. Ex: Compra ou Venda. Os códigos válidos são BUYI e SELL	
2.2.2.3.4.7.5		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the ISIN Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN.	
2.2.2.3.4.7.5.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O símbolo uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	

2.2.2.3.4.7.5.2		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.3.4.7.6		DealPrice	DealPric	[1..1]	+	Strategy leg trade price.	Preço da perna da estratégia.	
2.2.2.3.4.7.6.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Price expressed as a currency and value.	Preço expresso em valor e moeda.	
2.2.2.3.4.7.7		Quantity	Qty	[1..1]	+	Strategy leg trade quantity.	Quantidade da perna da estratégia.	
2.2.2.3.4.7.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

bvmf.028.02 – PositionTransferInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde os PNPs ou PLs podem solicitar a transferência de posição de derivativos fungíveis, não fungíveis e aluguel de ativos.

Por meio desta mensagem o participante também pode informar que há a transferência conjunta de colaterais e que, dessa forma, a avaliação de risco tanto na origem como no destino da transferência será realizada no portfólio conjunto de posições e colaterais.

Além disso, o participante pode solicitar a transferência interna de posição, onde há somente a transferência entres contas do mesmo participante. Neste tipo de transferência não há possibilidade de informar a transferência de colaterais.

Uso

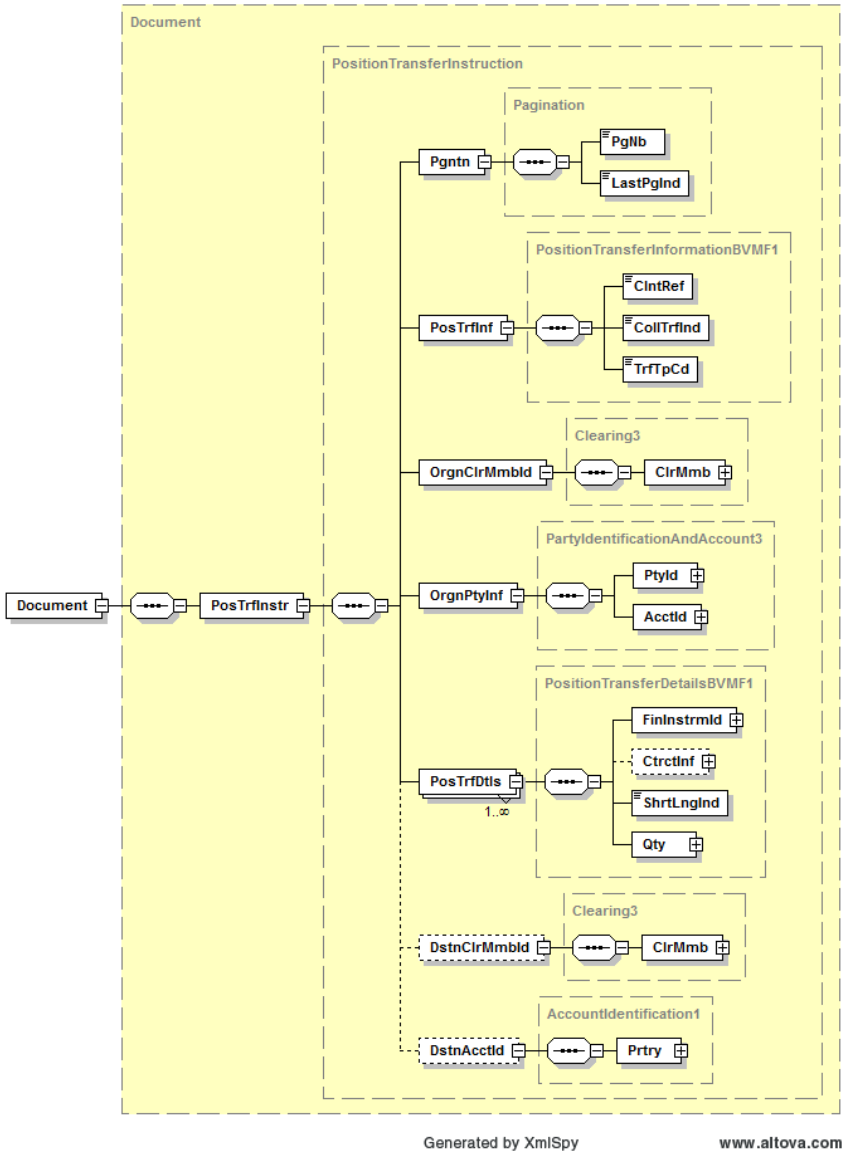
No envio da mensagem, o participante deve obrigatoriamente informar:

- os dados da origem da posição, ou seja, MC, participante e conta;
- o tipo de transferência, interna ou normal;
- se há transferência conjunta de colaterais;
- o número de identificação da transferência dado pelo próprio participante; e
- as posições a serem transferidas.

No caso de transferência do tipo interna, o participante deve informar o MC e a conta destino da transferência.

O envio da mensagem de solicitação de transferência deve obedecer os horários limite estabelecidos pela Clearing para este processo.

Diagrama da Mensagem


Document
PositionTransferInstruction
Pagination
Pgntn
PgNb
LastPgInd
PositionTransferInformationBVMF1
PosTrfInf
ClntRef
CollTrfInd
TrfTpCd
Clearing3
OrgnClrMmbId
ClrMmb
PartyIdentificationAndAccount3
OrgnPtyInf
PtyId
AcctId
Document
PosTrfInstr
PositionTransferDetailsBVMF1
PosTrfDtls
1..∞
FinInstrmId
CtrctInf
ShrtLngInd
Qty
Clearing3
DstnClrMmbId
ClrMmb
AccountIdentification1
DstnAcctId
Prtry
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1 – A informação de transferência conjunta de colaterais, não significa que os colaterais serão transferidos automaticamente. O participante deve comandar a transferência de colaterais no sistema de garantia. Vide documento de fluxo de mensagens.
R2 – O número do contrato a termo deve ser informado caso o participante queira transferir um contrato em específico. Se não for informado, o sistema irá transferir todos os contratos identificados pela trinca de instrumentos informada na mensagem.
R3 - No caso de transferência do tipo interna, o participante deve informar o MC e a conta destino da transferência.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	
1.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
1.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer, such as party reference (transfer number assigned by party), collateral request and internal transfer information.	Este bloco contém informações sobre a solicitação de transferência de posição, Código de referência do participante de negociação (número de transferência gerado/conhecido pelo participante de negociação), solicitação de transferência conjunta de colateral e as informações de transferência interna.	
2.1		ClientReference	ClntRef	[1..1]	Max35Text	The field "Client Reference" is used to identify the reference assigned by participant to position transfer.	O atributo "Client Reference" é usado para identificar a referência dada pelo participante para a transferência de posição.	

2.2		CollateralTransferIndicator	CollTrfInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether the transfer will have collateral. E.g: TRUE FALSE	Indica se na solicitação de transferência as garantias serão transferidas ou não. Ex TRUE FALSE	R1
2.3		TransferTypeCode	TrfTpCd	[1..1]	ExternalTransferTypeCode	Indicates if the position transfer is an internal transfer, e.g. The transfer is to the same Party, but different Account and/or Clearing Member. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Indica se a transferência é uma transferência de posição interna, por exemplo A transferência é para o mesmo participante de negociação pleno, mas a conta e / ou Membro de Compensação são diferentes. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
3.0		OriginClearingMemberIdentification	OrgnClrMmbId	[1..1]	+	Provides details about the origin clearing member identification in a position transfer process.	Fornece detalhes sobre a identificação do membro de compensação origem em um processo de transferência de posição.	
3.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
3.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
3.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		OriginPartyInformation	OrgnPtyInf	[1..1]	+	Party that legally owns the origin account in a position transfer process.	Participante que legalmente é proprietário da conta origem em um processo de transferência de posição.	
4.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
4.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
5.0		PositionTransfer Details	PosTrfDtls	[1..*]	+	Provides the position transfer details. E.g The instruments and the quantity to be transferred.	Fornece detalhes da transferência de posição. Ex: identificação do instrumento e quantidade a ser transferida.	

5.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification will be transferred in the position transfer process.	Fornece detalhes da identificação do instrumento que será transferido no processo de transferência de posição.	
5.1.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
5.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
5.1.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
5.1.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
5.1.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
5.1.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
5.2		ContractInformation	CtrctInf	[0..1]	+	Information about the forward contract.	Informação sobre o contrato a termo.	R2
5.2.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do contrato.	
5.3		ShortLongIndicator	ShrtLngInd	[1..1]	ShortLong1Code	Indicates if the position is short or long.	Indica se a posição é de compra ou venda.	
5.4		Quantity	Qty	[1..1]	+	Identifies the quantity of the instruments that will be transferred in the position transfer process.	Identifica a quantidade de instrumento que será transferida no processo de transferência de posição.	
5.4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
6.0		DestinationClearingMemberIdentification	DstnClrMmbId	[0..1]	+	Provides details about the destination clearing member identification in a position transfer process. This data block is only informed when is an internal transfer, e.g. The position transfer is to the same Party, but different Account and/or Clearing Member.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação destino no processo de transferência de posição. Este bloco somente é utilizado quando for uma transferência interna. Ex: A transferência de posição é para o mesmo participante de negociação, mas para diferente conta e/ou membro de	R3

							compensação.	
6.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
6.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
6.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
6.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
6.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
6.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
7.0		DestinationAccountIdentification	DstnAcctId	[0..1]	+	Provides destination account identification.	Fornece a identificação da conta destino.	R3

7.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
7.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

bvmf.030.01 – PositionTransferCancellation

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

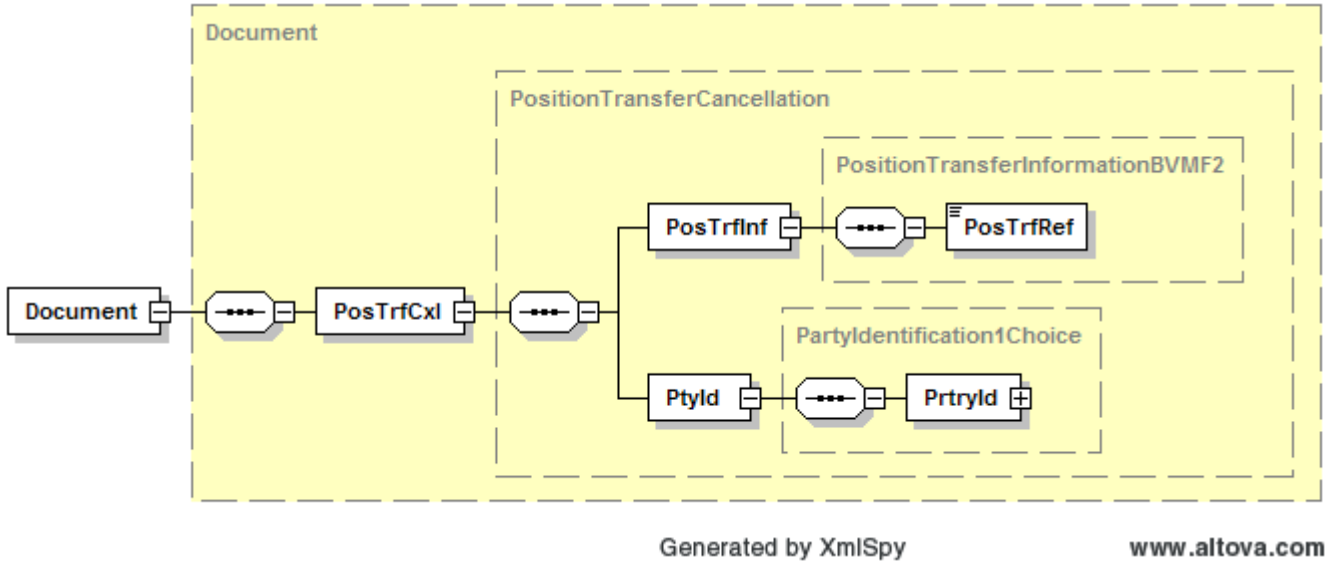
Mensagem onde os PNPs ou PLs, origem ou destino de transferência, podem solicitar o cancelamento da transferência de posição.

Uso

Esta mensagem somente pode ser utilizada até a transferência não estar efetivada. Se a transferência estiver efetivada, os participantes deverão solicitar o cancelamento diretamente para a Clearing.

O participante destino somente pode solicitar o cancelamento se já tiver ocorrido o recebimento da transferência.

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer.Transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process. The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição.Número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição. O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a a transferência de posição.	

						BM&FBOVESPA to a position transfer. By this number that the position transfer cancellation should be request.	Por este número o cancelamento da transferência de posição deverá ser solicitado.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Party that legally owns the account in a position transfer process. Party that is requesting position transfer cancellation.	Participante que legalmente é proprietário da conta em um processo de transferência de posição.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

bvmf.031.02 – PositionTransferStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência são informados do seu status.

Uso

Todos os passos do processo de transferência de posição podem ser realizados por tela ou mensagem.

Independentemente da forma como as etapas do fluxo são realizadas, todos os participantes envolvidos no fluxo receberão mensagens de atualização de status.

A mensagem de atualização de status é enviada nas seguintes situações:

- Alteração do status da transferência;

- Requisição de aprovação;

- Aprovação;

- Rejeição;

- Por requisição dos participantes;

- Cancelamento;

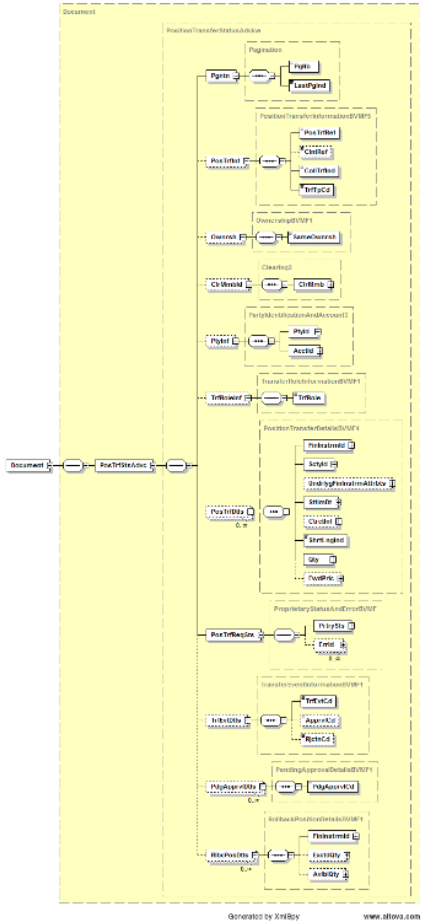
- Cancelamento de transferência em virtude de exercício ou entrega física; ou

- Erro de negócio.

O participante e MC destino somente receberão esta mensagem a partir do momento em que a transferência for recebida pelo destino.

Esta mensagem também pode ser gerada por requisição enviada pela mensagem bvmf.032.01.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – O número de referência somente será informado para o participante origem da transferência.

R2 – Somente será informado a partir do recebimento da transferência pelo destino.

R3 – Se o participante ou MC for origem e destino, receberá mais de uma mensagem de status.

R4 – Somente informado se houver contrato a termo no conteúdo da transferência.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número da página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação, informando se é a última página ou se existem mais.	
1.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
1.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	
2.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[0..1]	+	This block contains information regarding the position transfer. Transfer number, client reference, collateral indicator and transfer type.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição. Número de transferência, referência do participante, indicador de transferência conjunta de colaterais e tipo de transferência.	
2.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.2		ClientReference	ClntRef	[0..1]	Max35Text	The field "Client Reference" is used to identify the reference assigned by participant to position transfer.	O atributo "Client Reference" é usado para identificar a referência dada pelo participante para a transferência de posição.	R1
2.3		CollateralTransferIndicator	CollTrfInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether the transfer will have collateral. E.g: TRUE FALSE	Indica se haverá transferência conjunta de colaterais. Ex TRUE FALSE	

2.4		TransferTypeCode	TrfTpCd	[1..1]	ExternalTransferTypeCode	Indicates if the position transfer is an internal transfer, e.g. The transfer is to the same Party (Broker) but different Account and/or Clearing Member. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Indica se a transferência é uma transferência de posição interna, por exemplo A transferência é para o mesmo participante de negociação pleno (corretora), mas conta e / ou Membro de Compensação são diferentes. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
3.0		Ownership	Ownrsh	[0..1]	+	Specifies whether the transfer occurs between the same account ownership	Informa se a transferência de posição ocorre entre o mesmo titular da conta.	R2
3.1		SameOwnership	SameOwnrsh	[1..1]	YesNoIndicator	Specifies whether the transfer occurs between the same account ownership. . Eg: TRUE FALSE	Informa se a transferência de posição ocorre entre o mesmo titular da conta. Ex: TRUE FALSE	
4.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[0..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do membro de compensação.	
4.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
4.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
4.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

4.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
5.0		PartyInformation	PtyInf	[0..1]	+	Party that legally owns the account in a transfer process.	Participante que legalmente é proprietário da conta em um processo de transferência de posição.	
5.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
5.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

5.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
5.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
5.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
5.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
5.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
5.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
6.0		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[0..1]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém a informação do papel do participante na transferencia.	

6.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para derterminar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	R3
7.0		PositionTransfer Details	PosTrfDtls	[0..*]	+	Provides the transfer positions details. E.g The instruments to be transferred to another party, account or clearing member.	Fornece detalhes da transferência de posição. Ex: identificação do instrumento, quantidade a ser transferida para outro participante de negociação pleno, conta.	
7.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificacao do instrumento.	
7.1.1		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
7.1.1.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
7.1.2		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
7.1.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
7.1.2.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	

7.1.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
7.2		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains the Ticker Symbol.	Este bloco contem informações do bloco de negociação.	
7.2.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
7.3		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[0..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Característica do instrumento financeiro subjacente.	
7.3.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle.	

7.3.2		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
7.4		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	+	Maturity date.	Data de vencimento do contrato.	
7.4.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Date expressed as a calendar date.	Data expressa como data de calendário	
7.5		ContractInformation	CtrctInf	[0..1]	+	Information about the forward contract.	Informação sobre o contrato a termo.	R4
7.5.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do contrato.	
7.6		ShortLongIndicator	ShrtLngInd	[1..1]	ShortLong1Code	Indicates if the position is short or long.	Indica se a posição é comprada ou vendida.	
7.7		Quantity	Qty	[1..1]	+	Identifies the quantity of the instrument that will be transferred in the position transfer process.	Identifica a quantidade do instrumento que será transferida no processo de transferência de posição.	
7.7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
7.8		ForwardPrice	FwdPric	[0..1]	+	Price of the contract forward.	Preço do contrato a termo.	R4
7.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd7DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
8.0		PositionTransferRequestStatus	PosTrfReqSts	[1..1]	+	Indicates the position transfer request status.	Indica a situação da solicitação de transferência de posição.	
8.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
8.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Transfer status. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalPositionTransferRequestStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Status da transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPositionTransferRequestStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	

8.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
8.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	
9.0		TransferEventDetails	TrfEvtDtls	[0..1]	+	This block provides the event that triggered the message.	Este bloco fornece o evento pelo qual a mensagem foi disparada.	
9.1		TransferEventCode	TrfEvtCd	[1..1]	ExternalTransferEventCode	This field describes the event that triggered the message. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferEventCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo descreve o evento que disparou a mensagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferEventCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
9.2		ApprovalCode	ApprvlCd	[0..1]	ExternalStatusTransferEventCode	This field provides information of the user responsible for the approval event described in the field "TransferEventCode". If the transfer event description ='Transfer Approval required' or 'Transfer Approval Received', this field will be defined, stored and included in the message. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalStatusTransferEventCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este atributo fornece informações do usuário de aprovação do evento descrito no campo "TransferEventCode". Se a descrição do evento for igual a "Transfer Approval required" ou "Transfer Approval Received", então este campo será incluído na mensagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusTransferEventCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

9.3		RejectionCode	RjctnCd	[0..1]	ExternalStatusTransferEventCode	This field provides information of the user responsible for the rejection event described in the field "TransferEventCode". If the transfer event description ='Transfer Approval rejected', this field will be defined, stored and included in the message. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalStatusTransferEventCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este atributo fornece informações do usuário de Rejeição do evento descrito no campo "TransferEventCode". Se a descrição do evento for igual a "Transfer Approval Rejected", então este campo será incluído na mensagem. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalStatusTransferEventCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
10.0		PendingApproval Details	PdgApprvlDtls	[0..*]	+	This block provides information about pending approvals in the position transfer process.	Este bloco fornece informações das pendencias de aprovação no processo de transferência de posição.	
10.1		PendingApproval Code	PdgApprvlCd	[1..1]	ExternalPendingApprovalCode	This field provides information about all pending approvals related to position transfer process. The purpose of this field is to keep the participants updated on the status of the pending approvals of the position transfer. This field is to be updated each time RTC stores the need for an approval, and each time RTC receives an approval. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalPendingApprovalCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo fornece informações de todas as aprovações pendentes relacionadas a transferências de posição. O objetivo deste campo é manter os participantes atualizados sobre o status das aprovações pendentes da transferência de posição. Este campo é para ser atualizado a cada vez que o RTC armazena a necessidade de uma aprovação, e cada vez que o RTC recebe uma aprovação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPendingApprovalCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

11.0		RollbackPosition Details	RlbcPosDtls	[0..*]	+	This block provides information about the quantity of instruments that have been rolled back in the transfer position process and the quantity that is still available.	Este bloco fornece informações da quantidade de instrumentos que foram revertidos num processo de transferência e a quantidade que ainda está disponível.	
11.1		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
11.1.1		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
11.1.1.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
11.1.2		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
11.1.2.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
11.1.2.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
11.1.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
11.2		ExecutedQuantity	ExctdQty	[0..1]	+	Provides information about the quantity that has been rolled back.	Quantidade de instrumentos que foram revertidos.	
11.2.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
11.3		AvailableQuantity	AvlblQty	[0..1]	+	Provides information about the quantity that has not been rolled back yet.	Quantidade de instrumentos disponíveis para serem revertidos.	
11.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

bvmf.032.01 – RequestPositionTransferStatus

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

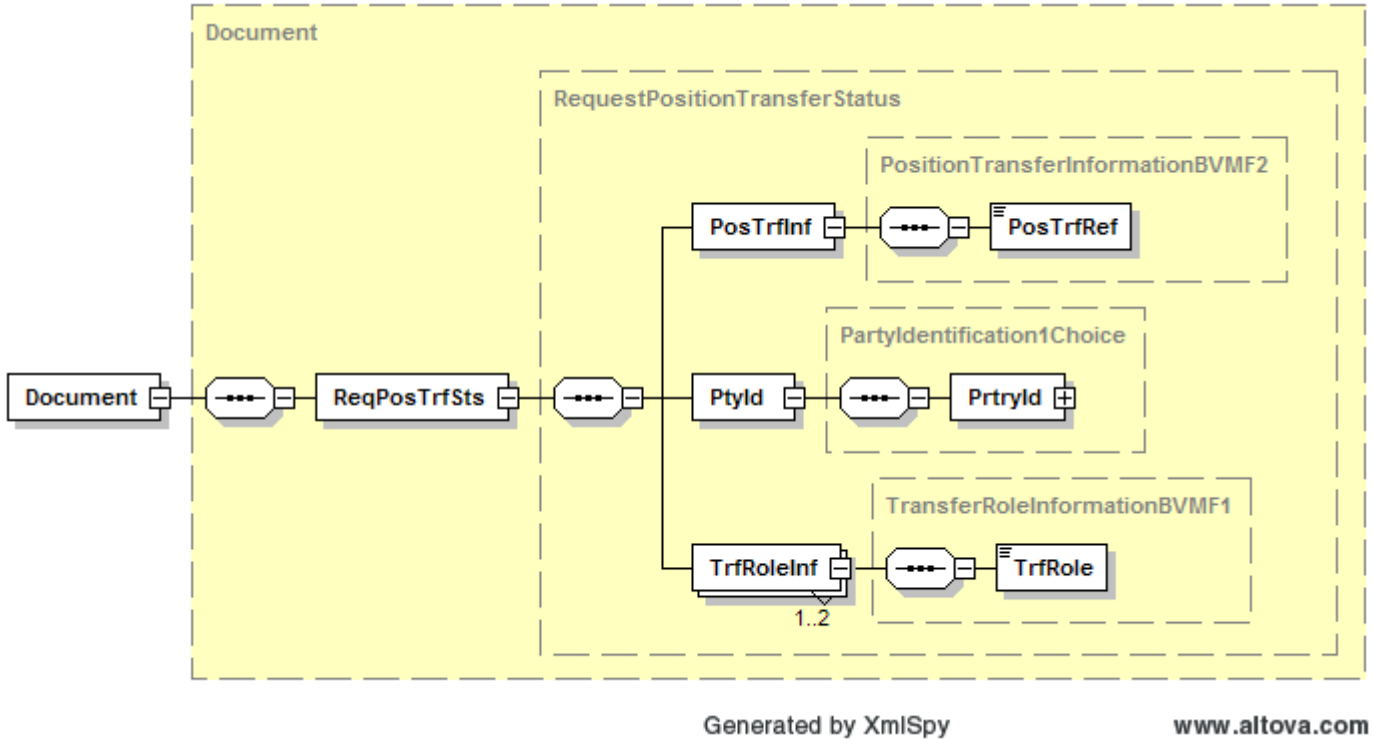
Mensagem onde todos os participantes envolvidos no processo de transferência podem solicitar o status da mesma.

Uso

O participante e MC destino somente podem solicitar o status a partir da efetivação do recebimento da transferência.

O envio desta mensagem deve obedecer os horários limite estabelecidos pela Clearing para este processo.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 – Se o participante ou MC for origem e destino, pode solicitar a mensagem de status com até dois papéis.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra

1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) . Transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição. Número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Party of that process has a legally transfer position.	Participante que legalmente tem um processo de transferência de posição.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[1..2]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém informação sobre o papel do participante na transferência.	

3.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para determinar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	R1

bvmf.033.01 – InformationPositionTransferReceiverLeg

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

O PNP ou PL destino envia a mensagem bvmf.033.01 para BM&FBOVESPA informando o recebimento da transferência no sistema.

Uso

No envio da mensagem, o participante deve obrigatoriamente informar:

- os dados do destino da posição, ou seja, MC, participante e conta;
- o tipo de requisição, prévia ou recebimento; e
- o código de transferência gerado pela Bolsa na solicitação.

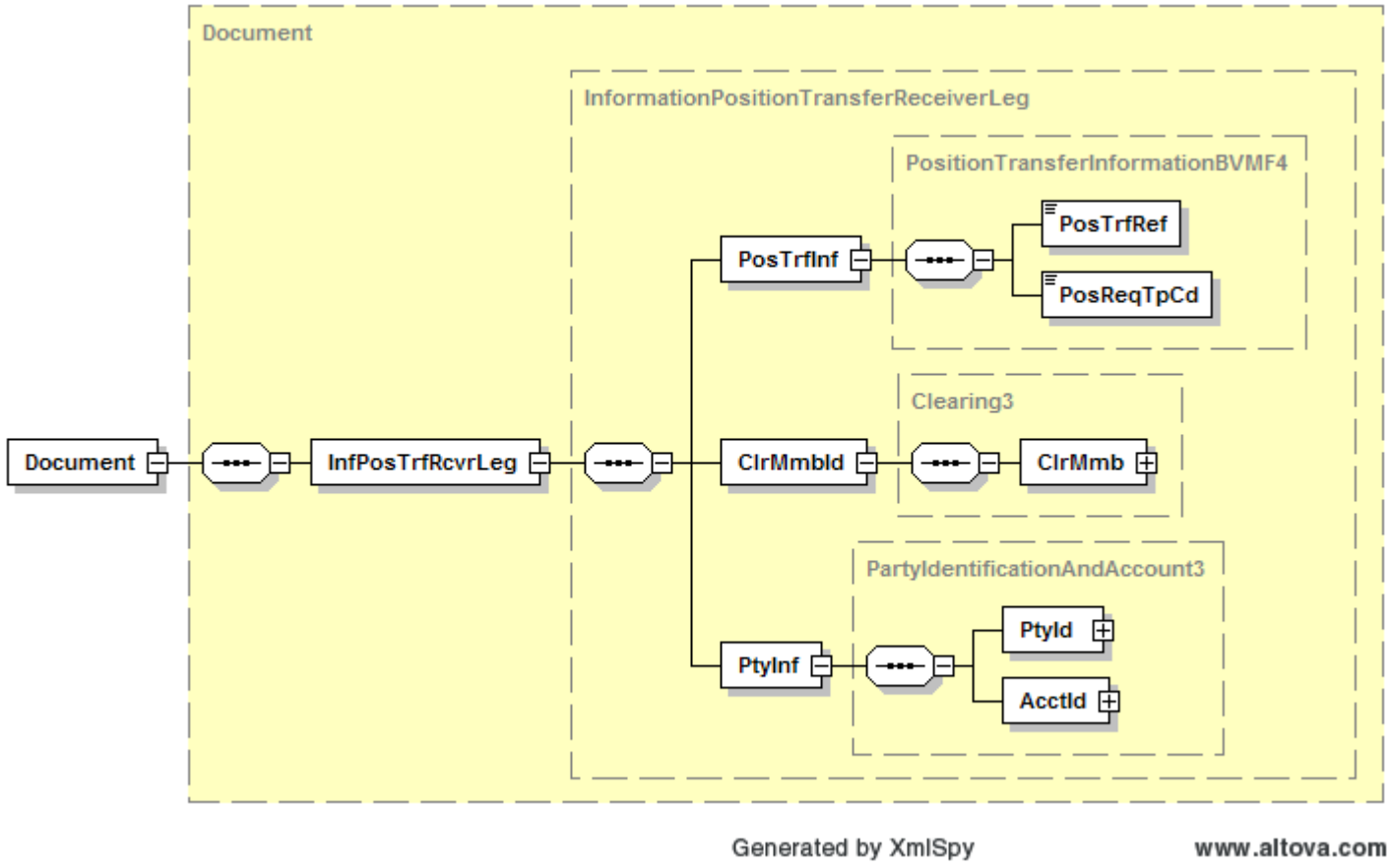
No caso de transferência do tipo interna, o recebimento é efetuado na própria solicitação.

O envio desta mensagem deve obedecer os horários limite estabelecidos pela Clearing para este processo.

O PNP ou PL pode solicitar uma prévia do recebimento para verificar a composição de posições da transferência.

A partir da efetivação do recebimento, nem um outro participante pode receber mais esta transferência.

Diagrama da Mensagem



Regras

Regra 1 - O PNP ou PL pode solicitar uma prévia do recebimento para verificar a composição de posições da transferência.Estrutura da Mensagem

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Item	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer.The transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição. O número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
1.2		PositionRequestTypeCode	PosReqTpCd	[1..1]	ExternalPositionRequestTypeCode	Request types : 1 - Preview 2 – Claim	Tipos de solicitação: 1 - Prévia 2 - Recebimento	R1
2.0		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides details about the destination clearing member identification. This is the clearing member of party what will receive the position transfer.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação destino. Este é o membro de compensação do participante de negociação pleno que receberá a transferência de posição.	
2.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Party that legally owns the destination account in a position transfer process. This party is what receive the position transfer.	Participante que legalmente é proprietário da conta destino no processo de transferência de posição. Este participante é aquele que irá receber a transferência de posição.	
3.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
3.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

bvmf.082.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

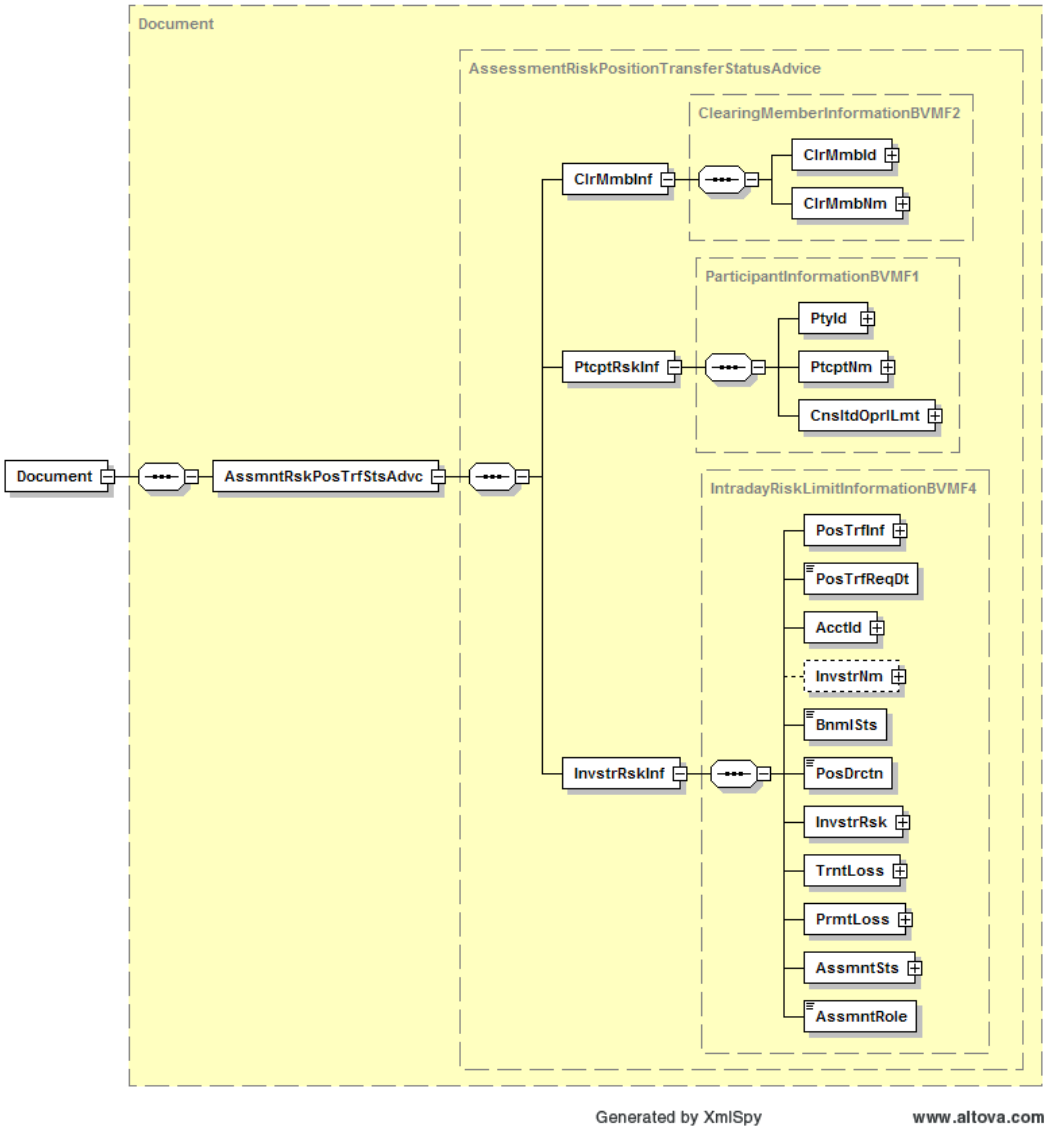
Escopo

A mensagem IntradayRiskLimitRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação informando a avaliação de risco de transferência de posição.

Uso

A mensagem IntradayRiskLimitRequest pode ser enviada voluntariamente após a avaliação do risco da transferência de posição solicitado. Se não houver violação de risco na origem, a aprovação do Membro de Compensação é desnecessária, portanto a mensagem não é enviada. Já o Membro de Compensação destino sempre precisa aprovar o fluxo de transferência.

Diagrama da Mensagem


Document
AssessmentRiskPositionTransferStatusAdvice
ClearingMemberInformationBVMF2
ClrMmbInf
ClrMmbId
ClrMmbNm
ParticipantInformationBVMF1
PtcptRskInf
PtyId
PtcptNm
CnsltdOprlLmt
Document
AssmntRskPosTrfStsAdvc
IntradayRiskLimitInformationBVMF4
PosTrfInf
PosTrfReqDt
AcctId
InvstrNm
BnmlSts
InvstrRskInf
PosDrctn
InvstrRsk
TrntLoss
PrmtLoss
AssmntSts
AssmntRole
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1- O atributo será vazio quando a mensagem é enviada ao Membro de Compensação e este não for participante também.

Estrutura da mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ClearingMemberInformation	ClrMmbInf	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informação do Membro de Compensação.	
1.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides Clearing Member Information.	Informa os detalhes de identificação do Membro de Compensação.	
1.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
1.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM& FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo:	

							Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM& FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		ClearingMemberName	ClrMmbNm	[1..1]	+	Provides Clearing Member name.	Informação do nome do Membro de Compensação.	
1.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.0		ParticipantRiskInformation	PtcptRskInf	[1..1]	+	This block contains identification information of the Participant and the consolidated operational limit value.	Este bloco contém informação de identificação do Participante e valor do limite operacional consolidado.	
2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	This block contains the information of participant identification	Este bloco contém as informaçãoes de identificação do participante	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM& FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BVM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BVM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		ParticipantName	PtcptNm	[1..1]	+	This block provides the information about the participant name.	Este bloco possui o nome do participante	
2.2.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
2.3		ConsolidatedOperationalLimit	CnsltdOprlLmt	[1..1]	+	This block contains the Consolidated Operational Limit of the Trading Participant/ Direct participant.	Este bloco contém o Limite de Risco Operacional consolidado do Participante de Negociação Pleno/ Participante de Liquidação.	
2.3.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
3.0		InvestorRiskInformation	InvstrRskInf	[1..1]	+	This block contains the information of the risk assessment related to transfer position.	Este bloco contém as informações da avaliação de risco relacionada a transferência de posição.	

3.1		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) such as transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição, assim como o número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
3.1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
3.2		PositionTransferRequestDate	PosTrfReqDt	[1..1]	ISODateTime	Date and time of the position transfer request.	Data da solicitação da transferência de posicao.	
3.3		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides Identification Account.	Fornece a identificação da conta.	
3.3.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.3.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.4		InvestorName	InvstrNm	[0..1]	+	Provides investor name.	Nome do investidor.	R1
3.4.1		ShortName	ShrtNm	[1..1]	Max20Text	Short name.	Nome reduzido.	
3.5		BinomialStatus	BnmlSts	[1..1]	ExternalBinomialStatusCode	If instrument for Derivatives and binomial indicator is true, it means that the broker will assume the responsibilities of guarantees that were investor's responsability. If instrument for Equity and binomial indicator is true, it means that the investor will assume the responsibilities of guarantees that were the broker's responsability.	Se instrumento for Derivativo e o indicador de binômial for verdadeiro, significa que a corretora irá assumir as responsabilidades de garantias que eram do investidor. Se instrumento for Equity e o indicador de binômial for verdadeiro, significa que o investidor irá assumir as responsabilidades de garantias que eram da corretora.	
3.6		PositionDirection	PosDrctn	[1..1]	ExternalPositionDirectionCode	Indicates if this account is the account of the transfer source or destination.	Indica se a conta refere-se a origem ou destino da transferência.	
3.7		InvestorRisk	InvstrRsk	[1..1]	+	The final simulated risk result from CORE 0.	Resultado final do risco do investidor.	
3.7.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	

3.8		TransientLoss	TrntLoss	[1..1]	+	The amount of the transient loss if the transfer is complete. This field is available when the content of the field "Account Type" is "Normal".	Informa o valor da perda transitória da transferência completa. Este campo está disponível quando o conteúdo do "Tipo de conta" for igual a "Normal".	
3.8.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
3.9		PermanentLoss	PrmtLoss	[1..1]	+	The amount of the permanent loss if the transfer is complete. This field is available when the content of the field "Account Type" is "Normal".	Informa o valor da perda permanente, se a transferência for concluída. Este campo está disponível quando o conteúdo do "Tipo de conta" for igual a "Normal".	
3.9.1		Amount	Amt	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Amount of money.	Valor em moeda.	
3.10		AssessmentStatus	AssmntSts	[1..1]	+	Provides details about risk assesment status. Status is related do approval role and side.	Detalhes sobre o status da avaliação de risco. O status está relacionado à regra de aprovação e ao lado aprovador.	
3.10.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the message.	Informações da situação relacionada a mensagem.	
3.10.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalAssessmentStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalAssessmentStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.11		AssessmentRole	AssmntRole	[1..1]	ExternalAssessmentRoleCode	Role of last or next executor.	Função do executor (próximo ou último).	

bvmf.083.01– AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse

Funcionalidade da Mensagem

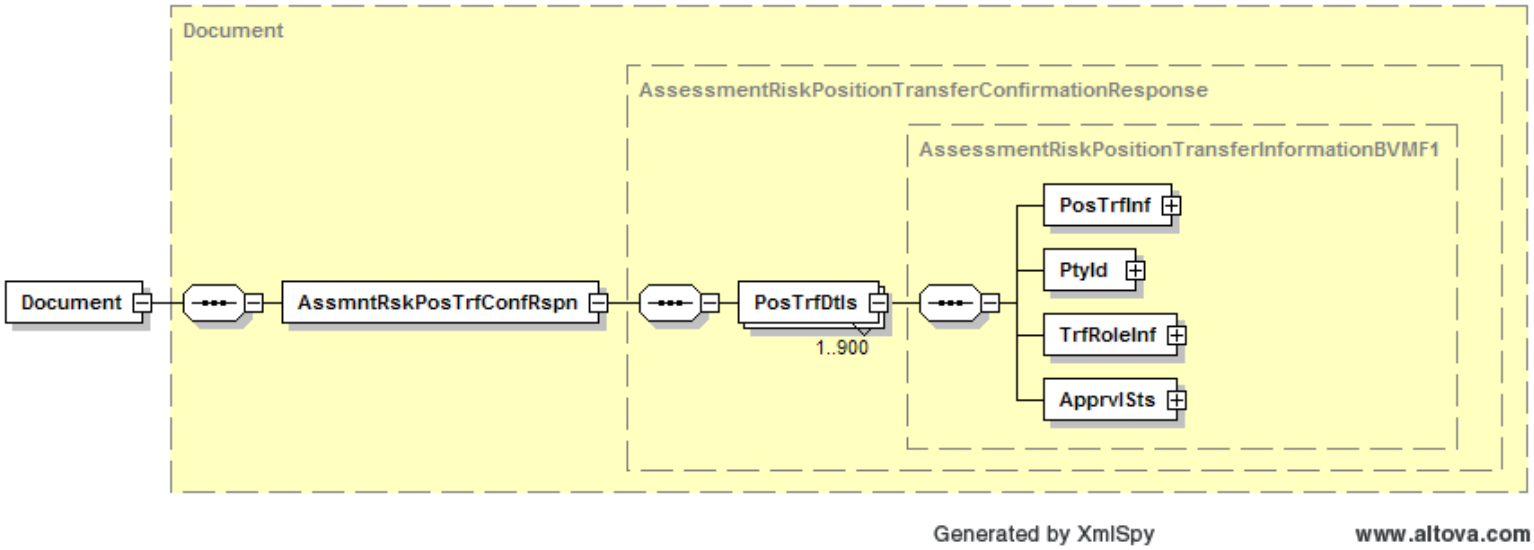
Escopo

A mensagem AssessmentRiskPositionTransferConfirmationResponse é enviada pelo Membro de Compensação à BM&FBOVESPA para informar a aceitação ou rejeição da avaliação de risco de transferência de posição.

Uso

O Membro de compensação deve aprovar o risco de transferência de posição. Se não houver violação de risco na origem, a aprovação do Membro de Compensação é desnecessária. Já o Membro de Compensação sempre precisa aprovar o fluxo de transferência.

Diagrama da Mensagem



Estrutura da mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferDetails	PosTrfDtls	[1..900]	+	This bloco contains information about risk assessment related to position transfer that will be approval or rejects by clearing member.	Este bloco contém informações sobre as avaliações de risco relacionadas a transferência de Posição que serão aprovadas ou rejeitas pelo membro de compensação.	
1.1		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) such as transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição, assim como o número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
1.2		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

1.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.3		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[1..1]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém informação sobre o papel do participante na transferência.	
1.3.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para determinar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
1.4		ApprovalStatus	ApprvlSts	[1..1]	+	Status of approval of the position transfer process. This is the response of the clearing member to approve or rejecting a request.	Situação da aprovação da avaliação de risco. Esta é a resposta do membro de compensação para aprovar ou rejeitar uma avaliação de risco.	
1.4.1		RiskApprovalType	RskApprvlTp	[1..1]	ExternalRiskApprovalTypeCode	This attribute indicates the origin of the transfer approval. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalRiskApprovalTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo indica o origem da aprovação da transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRiskApprovalTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
1.4.2		RiskAssessmentApprovalStatus	RskAssmntApprvlSts	[1..1]	ExternalApprovalStatusCode	This attribute informs whether the Clearing Member is approving or rejecting the risk assessment. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is ExternalApprovalStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo informa se o membro de compensação está aprovando ou rejeitando avaliação do risco. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitas em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalApprovalStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

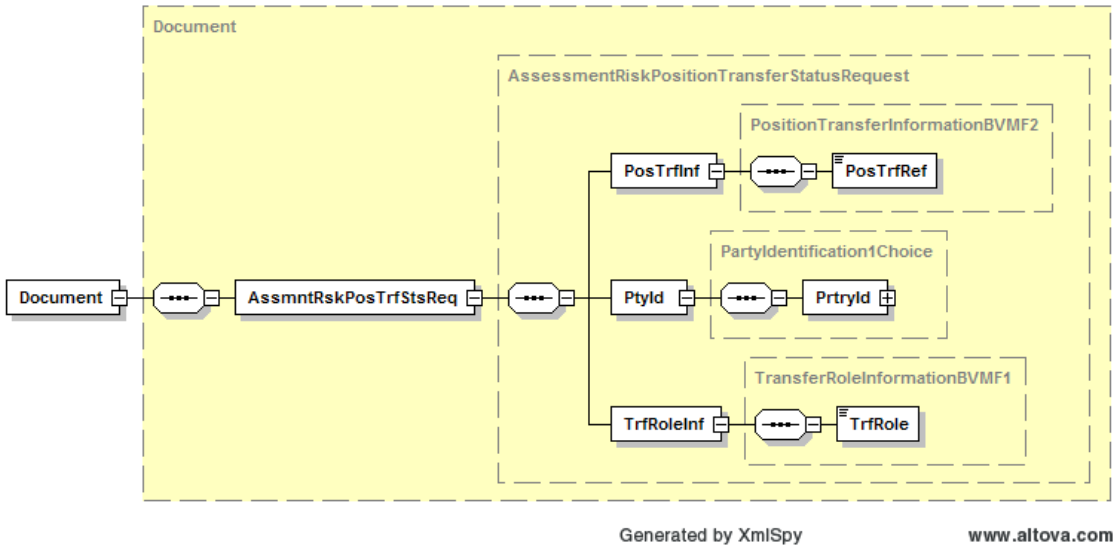
bvmf.084.01– AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem AssessmentRiskPositionTransferStatusRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação ou Membro de Compensação à BM&FBOVESPA como requisição das informações atualizadas da avaliação do risco de transferência de posição.

Diagrama da Mensagem



Estrutura da mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PositionTransferInformation	PosTrfInf	[1..1]	+	This block contains information regarding the position transfer,) such as transfer number given by BM&FBOVESPA in the position transfer process.	Este bloco contém informações sobre a transferência de posição, assim como o número de transferência dado BM&FBOVESPA no processo de transferência de posição.	
1.1		PositionTransferReference	PosTrfRef	[1..1]	RestrictedPosMax15Text	The field "PositionTransferReference" is used to identify the reference given by BM&FBOVESPA to a position transfer.	O atributo "PositionTransferReference" é usado para identificar a transferência de posição.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

3.0		TransferRoleInformation	TrfRoleInf	[1..1]	+	This block contains information about the transfer role.	Este bloco contém informação sobre o papel do participante na transferência.	
3.1		TransferRole	TrfRole	[1..1]	ExternalTransferRoleCode	Used to determine the transfer role. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalTransferRoleCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Usado para determinar o papel do participante na transferência. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalTransferRoleCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

bvmf.115.01 - BlockExerciseInstruction

Funcionalidade da Mensagem

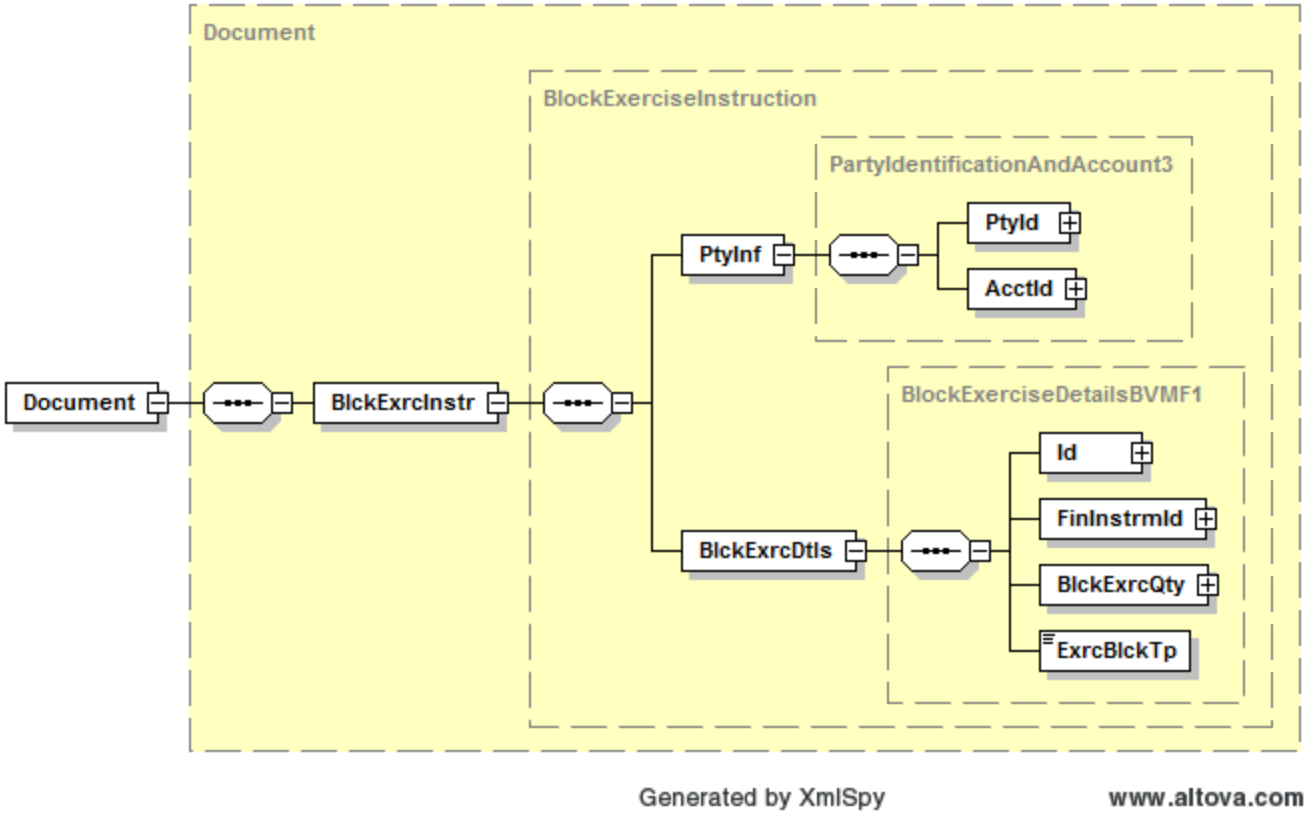
Escopo

Mensagem onde PNPs e PLs responsáveisl por posição titular podem solicitar o bloqueio de exercício de opção.

Uso

Esta mensagem permite o bloqueio de exercício de opção.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – Zero é um valor válido.

Estrutura da mensagem bvmf.115.01 – BlockExerciseInstruction

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains the participant and account identification.	Este bloco contém as informações do participante e conta.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

2.0		BlockExerciseDetails	BlckExrcDtls	[1..1]	+	Provide information about blocking exercise.	Fornecer informações sobre o bloqueio de exercício.	
2.1		Identification	Id	[1..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identifica inequivocamente a transação, gerada a partir da parte requerente.	
2.1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction as known by the instructing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.2		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificacao do instrumento.	
2.2.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.3		BlockExerciseQuantity	BlckExrcQty	[1..1]	+	Identifies the quantity of instruments that will be blocked.	Identifica a quantidade de instrumentos que será bloqueada.	R1
2.3.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
2.4		ExerciseBlockType	ExrcBlckTp	[1..1]	ExternalExerciseBlockTypeCode	Provides the types of block exercise. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalExerciseBlockTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Fornece os tipos de bloqueio do exercicio. Este campo requer uma lista de códigos externos. Estes códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalExerciseBlockTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF_Fase2.xls.	

bvmf.116.01 -BlockExerciseStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

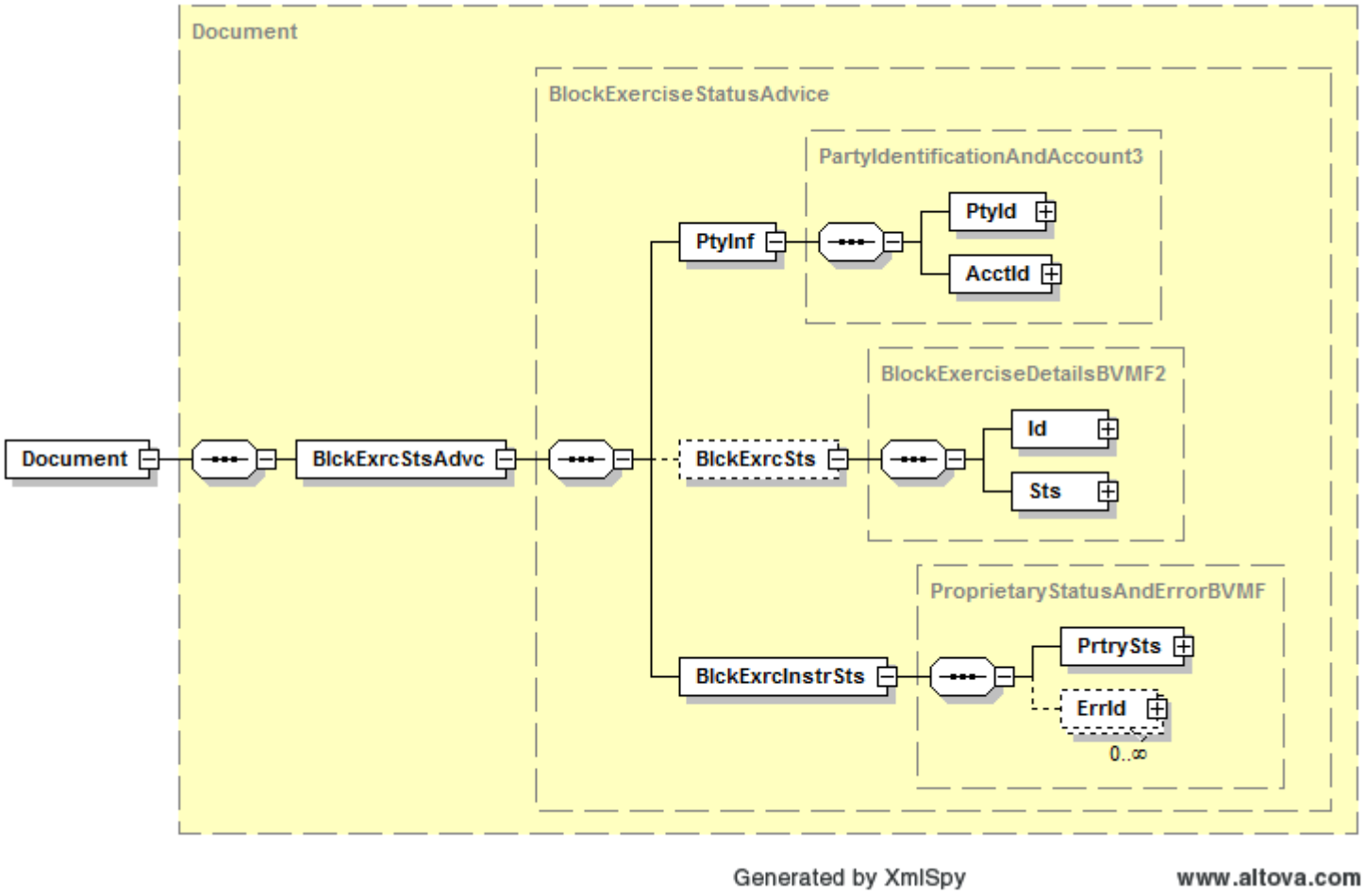
Escopo

Mensagem utilizada pela BM&FBOVESPA para informar o participante sobre o status da solicitação de bloqueio de exercício.

Uso

Esta mensagem permite informar o participante a solicitação de bloqueio.

Diagrama da mensagem



Regras

N/A

Estrutura

bvmf.116.01 – BlockExerciseStatusAdvice

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regras
1.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains the participant and account identification.	Este bloco contém as informações do participante e conta.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.0		BlockExerciseStatus	BlckExrcSts	[0..1]	+	This block contains information about the status of each block exercise related to the instrument.	Este bloco contém informações sobre o status de cada bloqueio de exercício relacionado ao instrumento.	
2.1		Identification	Id	[1..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identifica inequivocamente a transação, gerada a partir da parte requerente.	
2.1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction as known by the instructing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.2		Status	Sts	[1..1]	+	This block provides the status of each block exercise requested.	Este bloco fornece o status de cada bloqueio de exercício solicitado.	
2.2.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
2.2.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalExerciseBlockStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalExerciseBlockStatusCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
2.2.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	
3.0		BlockExerciseInstructionStatus	BlckExrcInstrSts	[1..1]	+	Show the information about status message.	Apresenta o status da solicitação da mensagem.	
3.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
3.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalExerciseBlockInstructionStatusCode	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalExerciseBlockInstructionStatusCode	

						in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
3.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
3.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	

bvmf.171.01 - EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest

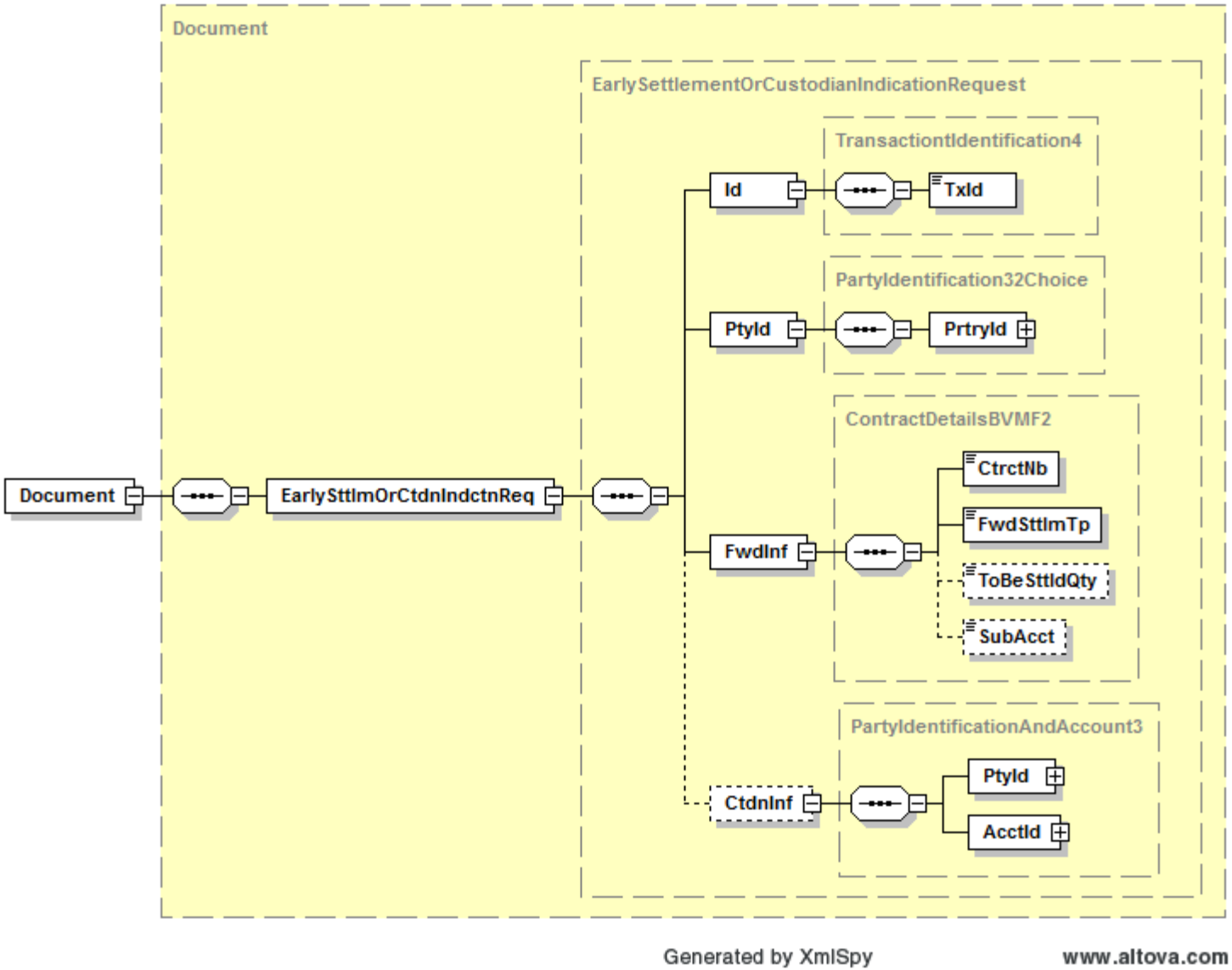
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação comprador à BM&FBOVESPA para solicitar a liquidação antecipada de termo ou direcionamento de custodiante de liquidação de termo;

Uso

Diagrama da Mensagem


Document
EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest
TransactionIdentification4
Id
TxId
PartyIdentification32Choice
PtyId
PrtryId
ContractDetailsBVMF2
CtrctNb
FwdSttlmTp
ToBeSttldQty
SubAcct
FwdInf
PartyIdentificationAndAccount3
PtyId
AcctId
CtdnInf
Document
EarlySttlmOrCtdnIndctnReq
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1 – Preenchimento obrigatório para Indicação de Custodiante.

R2 – Preenchimento obrigatório no caso de liquidação antecipada.

Estrutura da mensagem bvmf.171.01 – EarlySettlementOrCustodianIndicationRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identificação única da transação, gerada pelo Participante solicitante.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		ForwardInformation	FwdInf	[1..1]	+	Block with the details of the forward contract.	Bloco com detalhes do contrato de termo.	
3.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	

3.2		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[1..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de liquidação de termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
3.3		ToBeSettledQuantity	ToBeSttldQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Quantity to be settled.	Quantidade a ser liquidada.	R2
3.4		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária.	
4.0		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia e da conta de custódia.	R1
4.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
4.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

4.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	

bvmf.172.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice

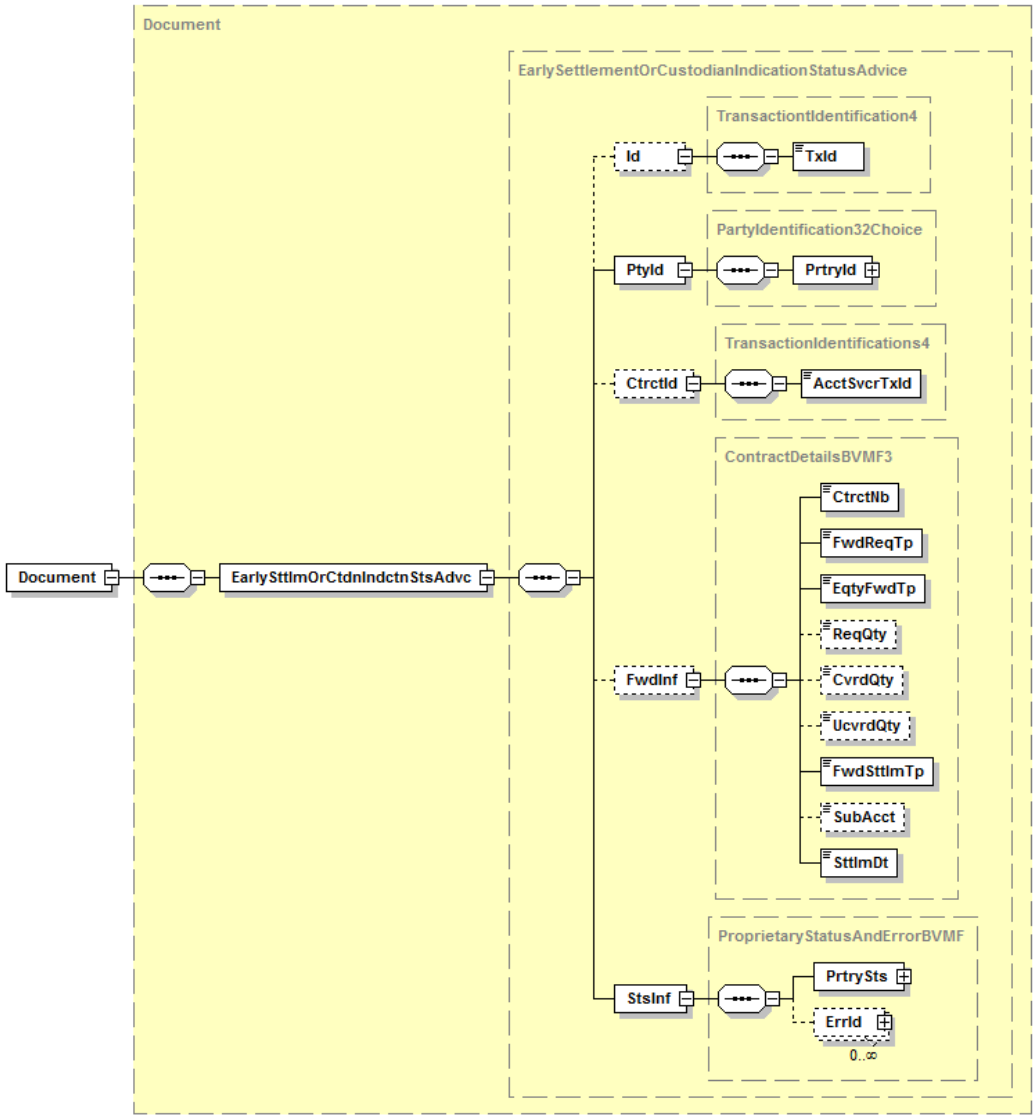
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice pela BM&FBOVESPA ao Participante de Liquidação Pleno ou Participante de Liquidação (comprador e vendor) e Custodiante para informar o status da liquidação da antecipada ou do direcionamento de custodiante.

Uso

Diagrama da Mensagem


Document
EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice
TransactionIdentification4
Id
TxId
PartyIdentification32Choice
PtyId
PrtryId
TransactionIdentifications4
CtrctId
AcctSvcrTxId
ContractDetailsBVMF3
CtrctNb
FwdReqTp
EqtyFwdTp
ReqQty
FwdInf
CvrdQty
UcvrdQty
FwdSttlmTp
SubAcct
SttlmDt
ProprietaryStatusAndErrorBVMF
StsInf
PrtrySts
ErrId
0..∞
Document
EarlySttlmOrCtdnIndctnStsAdvc
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1 – Este bloco não é informado no caso de Indicação de Custodiante.

R2 – Este bloco somente deve ser exibido ao participante que iniciou o fluxo.

R3 – Quantida coberta da quantidade solicitada.

R4 – Quantida descoberta da quantidade solicitada.

R5 – Este campo deve ser exibido somente para o custodiante comprador.

R6 - Esse campo é obrigatório no caso de liquidação antecipada.

Estrutura da mensagem bvmf.172.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationStatusAdvice

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[0..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identificação única da transação, gerada pelo Participante solicitante.	R2
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		ContractIdentification	CtrctId	[0..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to request.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a solicitação.	R1
3.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	R6
4.0		ForwardInformation	FwdInf	[0..1]	+	Block with the details of the forward contract.	Bloco com detalhes do contrato de termo.	
4.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
4.2		ForwardRequestType	FwdReqTp	[1..1]	ExternalFowardRequestTypeCode	Request type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardRequestTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de Requisição. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardRequestTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.3		EquityForwardType	EqtyFwdTp	[1..1]	ExternalEquityForwardTypeCode	Equity forward type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalEquityForwardTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de Termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalEquityForwardTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.4		RequestQuantity	ReqQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the requested quantity.	Indica a quantidade solicitada.	
4.5		CoveredQuantity	CvrdQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the covered quantity.	Informa a quantidade coberta.	R3
4.6		UncoveredQuantity	UcvrdQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Provides the uncovered quantity.	Informa a quantidade descoberta.	R4
4.7		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[1..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from	Tipo de liquidação de termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os	

						BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.8		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da Carteira na depositária.	R5
4.9		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	ISODate	Settlement date.	Data de liquidação.	
5.0		StatusInformation	StsInf	[1..1]	+	This block contains the status information of early settlement request or custodian indication.	Este bloco contém a informação do status da Liquidação Antecipada ou Indicação de Custodiante.	
5.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
5.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalForwardStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalForwardStatusCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
5.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
5.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	

bvmf.173.01- CustodianIndicationApprovalRequest

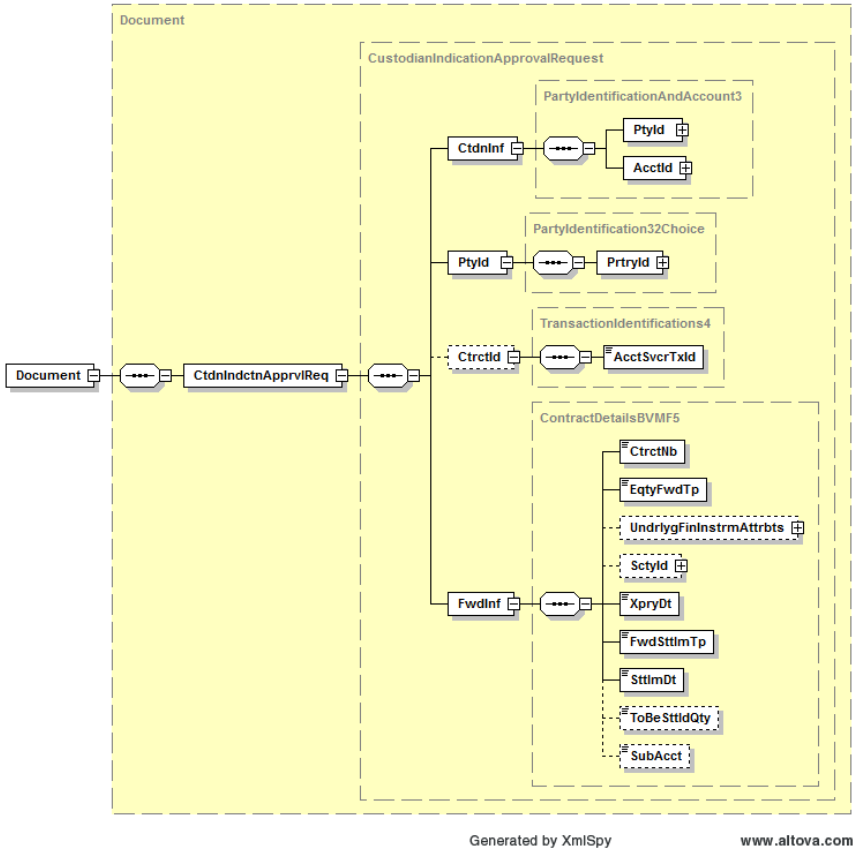
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem CustodianIndicationApprovalRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Custodiante, para requisitar confirmação de direcionamento de custodiante.

Uso

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – Este bloco não é informado no caso de Indicação de Custodiante.

R2 – Esse campo é obrigatório no caso de liquidação antecipada.

R3 – Em caso de indicação de custodiante a quantidade informada deverá ser a total do contrato.

Estrutura da mensagem bvmf.173.01- CustodianIndicationApprovalRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		CustodianInformation	CtdnInf	[1..1]	+	Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia e da conta de custódia.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification that requested custodian indication.	Fornece detalhes da identificação do participante que solicitou a indicação de custodiante.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		ContractIdentification	CtrctId	[0..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to request.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a solicitação.	R1
3.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	R2

4.0		ForwardInformation	FwdInf	[1..1]	+	Block with the details of the forward contract.	Bloco com detalhes do contrato de termo.	
4.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
4.2		EquityForwardType	EqtyFwdTp	[1..1]	ExternalEquityForwardTypeCode	Equity forward type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalEquityForwardTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de Termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalEquityForwardTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.3		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[0..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Características do instrumento financeiro subjacente.	
4.3.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle.	

4.3.2		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
4.4		SecurityIdentification	SctyId	[0..1]	+	This block contains the ticker symbol.	Este bloco contém informações de código de negociação.	
4.4.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
4.5		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	ISODate	Expiration date of the contract.	Data de vencimento do contrato.	
4.6		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[1..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de liquidação de termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.7		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	ISODate	Settlement date.	Data de liquidação.	
4.8		ToBeSettledQuantity	ToBeSttldQty	[0..1]	RestrictedFINDecimalNumber	Quantity to be settled.	Quantidade a ser liquidada.	R3
4.9		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da Carteira na depositária.	

bvmf.174.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse

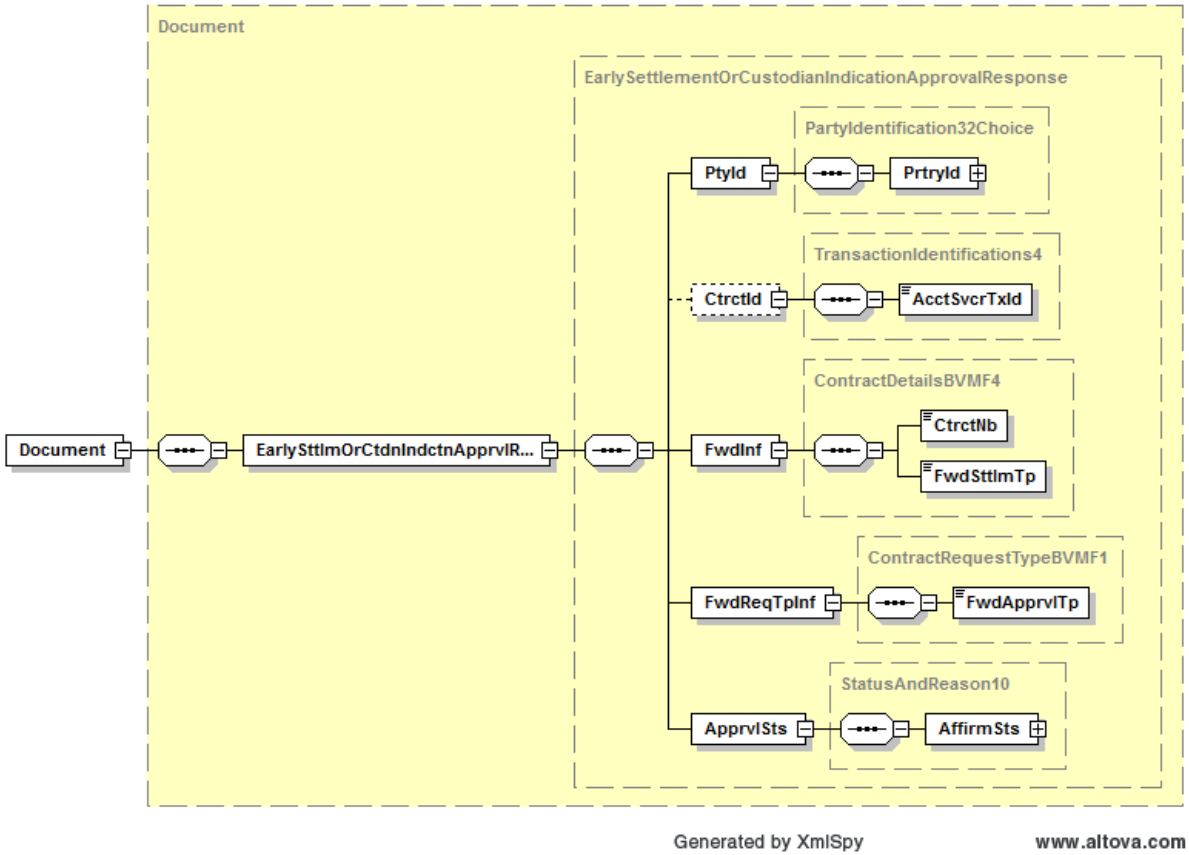
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse é enviada pelo Custodiante à BM&FBOVESPA com a aprovação ou rejeição da solicitação de liquidação antecipada e direcionamento de custodiante.

Uso

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – Este bloco somente será preenchido no caso de aprovação/ rejeição de cancelamento da liquidação antecipada do termo.

R2 – Esse campo é obrigatório no caso de liquidação antecipada.

Estrutura da mensagem bvmf.174.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalResponse

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		ContractIdentification	CtrctId	[0..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to request.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a solicitação.	R1
2.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	R2

3.0		ForwardInformation	FwdInf	[1..1]	+	Block with the details of the forward contract.	Bloco com detalhes do contrato de termo.	
3.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
3.2		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[1..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de liquidação de termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.0		ForwardRequestTypeInformation	FwdReqTpInf	[1..1]	+	This block informs the type of request that will be approved or rejected.	Este bloco informa o tipo de solicitação será aprovada ou rejeitada.	
4.1		ForwardApprovalType	FwdApprvlTp	[1..1]	ExternalForwardApprovalTypeCode	It indicates what type of approval. The "Code" field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is "ExternalForwardApprovalTypeCode" in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Informa o tipo de aprovação. Os valores para este campo podem ser consultados nas listas de códigos da BM&FBOVESPA (ExternalCodeLists). Os valores foram registrados em listas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso os valores podem ser obtidos na aba ExternalForwardApprovalTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
5.0		ApprovalStatus	ApprvlSts	[1..1]	+	This block contains information about approval or rejection of the request of the contract.	Este bloco contém informação da aprovação ou rejeição de determinada solicitação de contrato.	
5.1		AffirmationStatus	AffirmSts	[1..1]	+	This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
5.1.1		Code	Cd	[1..1]	AffirmationStatus1Code	AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	

bvmf.175.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest

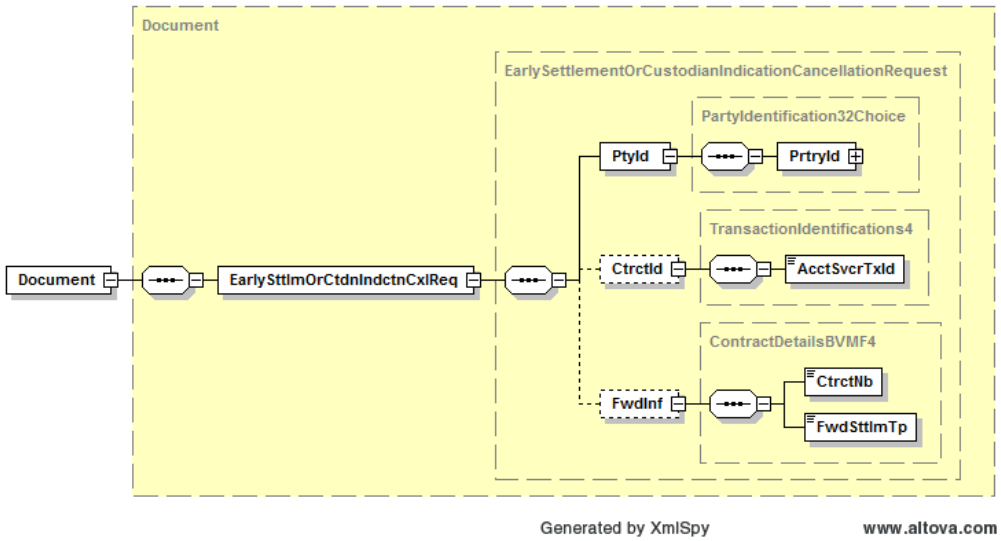
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação comprador à BM&FBOVESPA solicitando o cancelamento da liquidação antecipada de termo ou direcionamento de custodia.

Uso

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – Esse campo é obrigatório no caso de liquidação antecipada.

R2 – Campo preenchido somente se for indicação de custodiante.

Estrutura da mensagem bvmf.175.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationCancellationRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.0		ContractIdentification	CtrctId	[0..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to request.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a solicitação.	
2.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	R1
3.0		ForwardInformation	FwdInf	[1..1]	+	Block with the details of the forward contract.	Bloco com detalhes do contrato de termo.	R2
3.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
3.2		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[1..1]	ExternalFowardSettlementType	Forward Settlement Type. This field requires an external code list. Those	Tipo de liquidação de termo.	

					Code	codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

bvmf.176.01- EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest

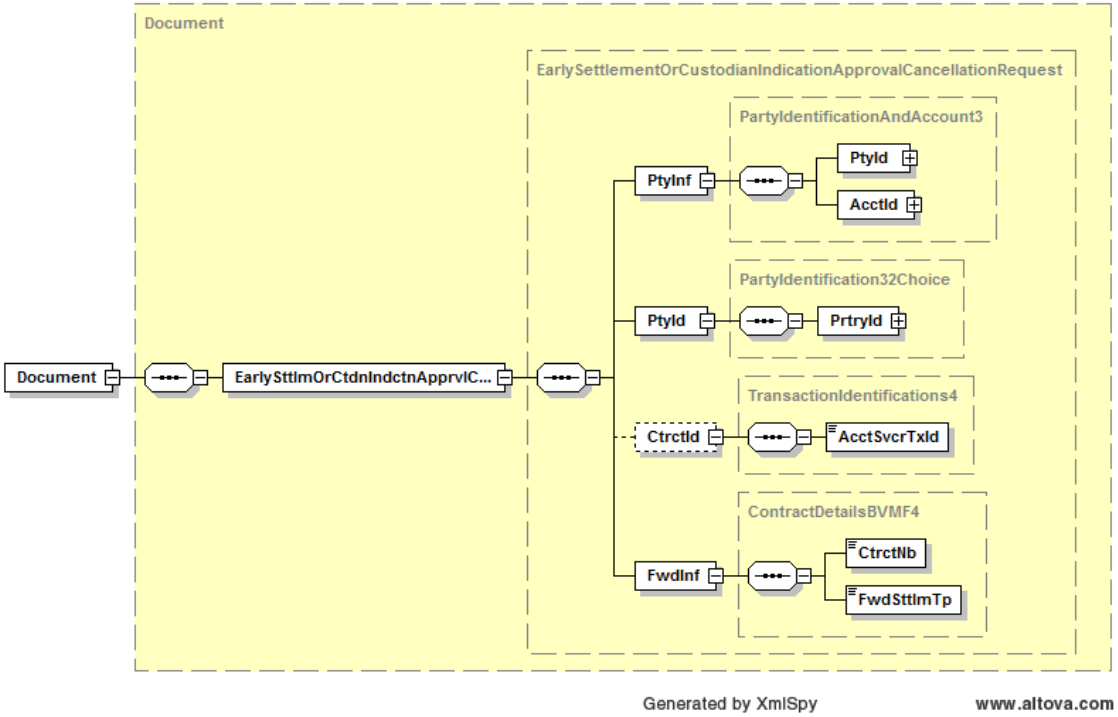
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest é enviada pela BM&FBOVESPA ao Custodiante como requisição de confirmação de cancelamento de liquidação antecipada de termo ou direcionamento de custódia.

Uso

Diagrama da Mensagem



Regras

R1 – Esse campo é obrigatório no caso de liquidação antecipada.

Estrutura da mensagem bvmf.176.01EarlySettlementOrCustodianIndicationApprovalCancellationRequest

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains the participant and account identification.	Este bloco contém a identificação do participante e conta.	
1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	

1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification that requested custodian indication cancellation or early settlement cancellation.	Fornece detalhes da identificação do participante que solicitou o cancelamento da indicação de custodiante ou cancelamento da liquidação Antecipada.	
2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas	

						spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		ContractIdentification	CtrctId	[0..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to request.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a solicitação.	
3.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	R1
4.0		ForwardInformation	FwdInf	[1..1]	+	Block with the details of the forward contract.	Bloco com detalhes do contrato de termo.	
4.1		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
4.2		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[1..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de liquidação de termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

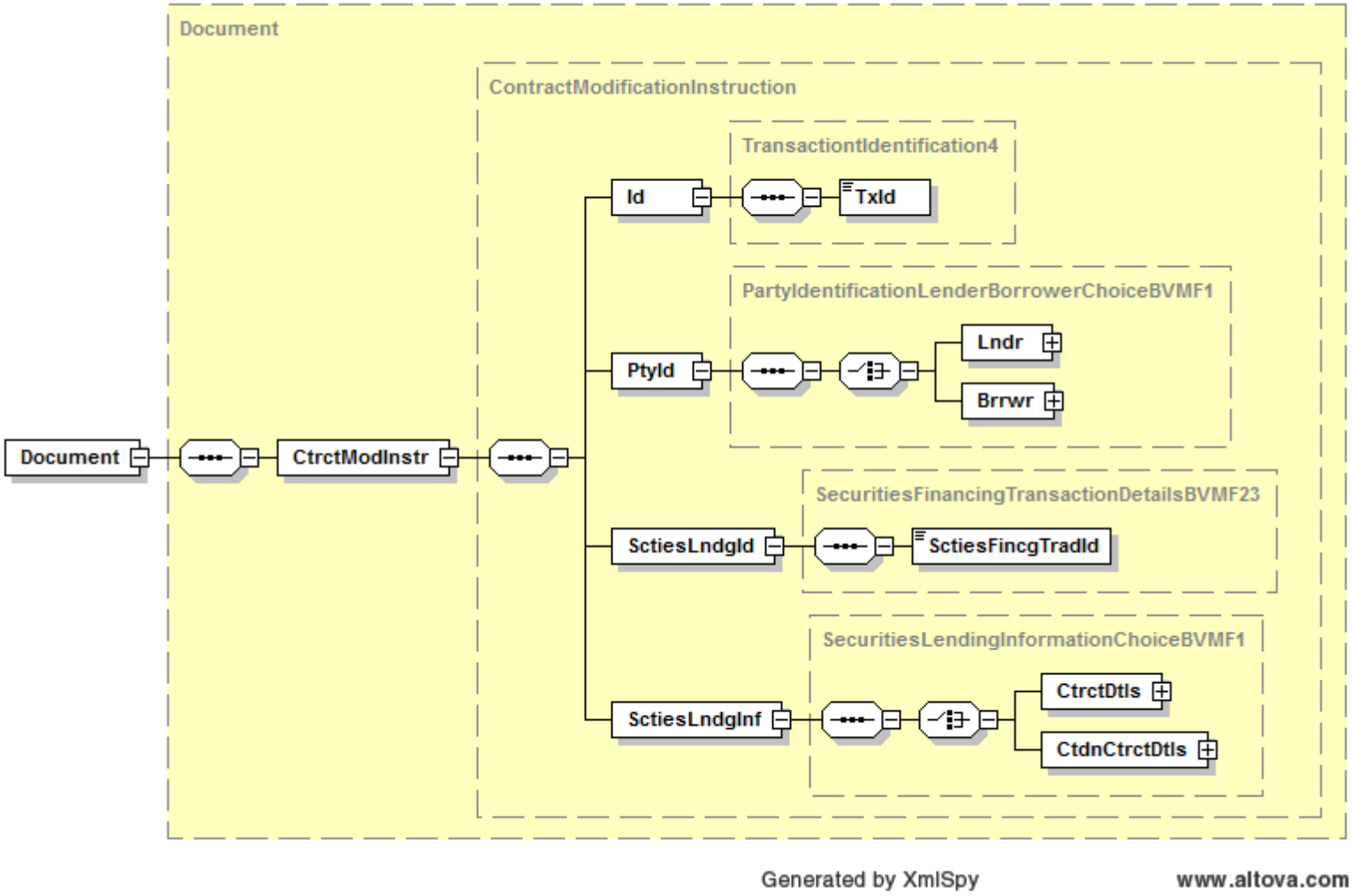
bvmf.129.01 - ContractModificationInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractModificationInstruction <bvmf.129.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor da posição do contrato de Aluguel de Ativos à BM&FBOVESPA, como requisição de alteração de dados do Contrato de Aluguel de Ativos e/ou alteração de Custodiante;.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1: Um contrato não pode ter o campo “Indicador de Liquidação antecipada em caso de OPA” (TenderOfferEarlySettlementIndicator) igual a false, se o campo “'Indicador de Liquidação Antecipada” (EarlyClosingIndicator) for igual a true.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identificação única da transação, gerada pelo Participante solicitante.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
2.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SecuritiesLendingIdentification	SctiesLndgId	[1..1]	+	Block with the contract ID.	Bloco com a identificação do contrato.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.0		SecuritiesLendingInformation	SctiesLndgInf	[1..1]	+	Block with the details of the Securities Lending contract.	Bloco com o detalhes do contrato de aluguel de ativos.	

4.1	{OR	ContractDetails	CtrctDtls	[1..1]	+	This block contains contract' Information that will be modified.	Bloco com informação sobre os dados do contrato que será alterado.	
4.1.1		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[0..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	
4.1.2		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente.	
4.1.3		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[0..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indicador de liquidação antecipada em caso de OPA.	R1
4.2	OR}	CustodianContract Details	CtdnCtrctDtls	[1..1]	+	This block contains Custodians' Information that will be modified.	Bloco com informação sobre os dados do custodiante do contrato que será alterado.	
4.2.1		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
4.2.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
4.2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
4.2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

4.2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.2.1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.2		SubAccountIdentification	SubAcctId	[0..1]	+	Provides identification of the sub account.	Fornece a identificação da carteira na depositária.	
4.2.2.1		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	

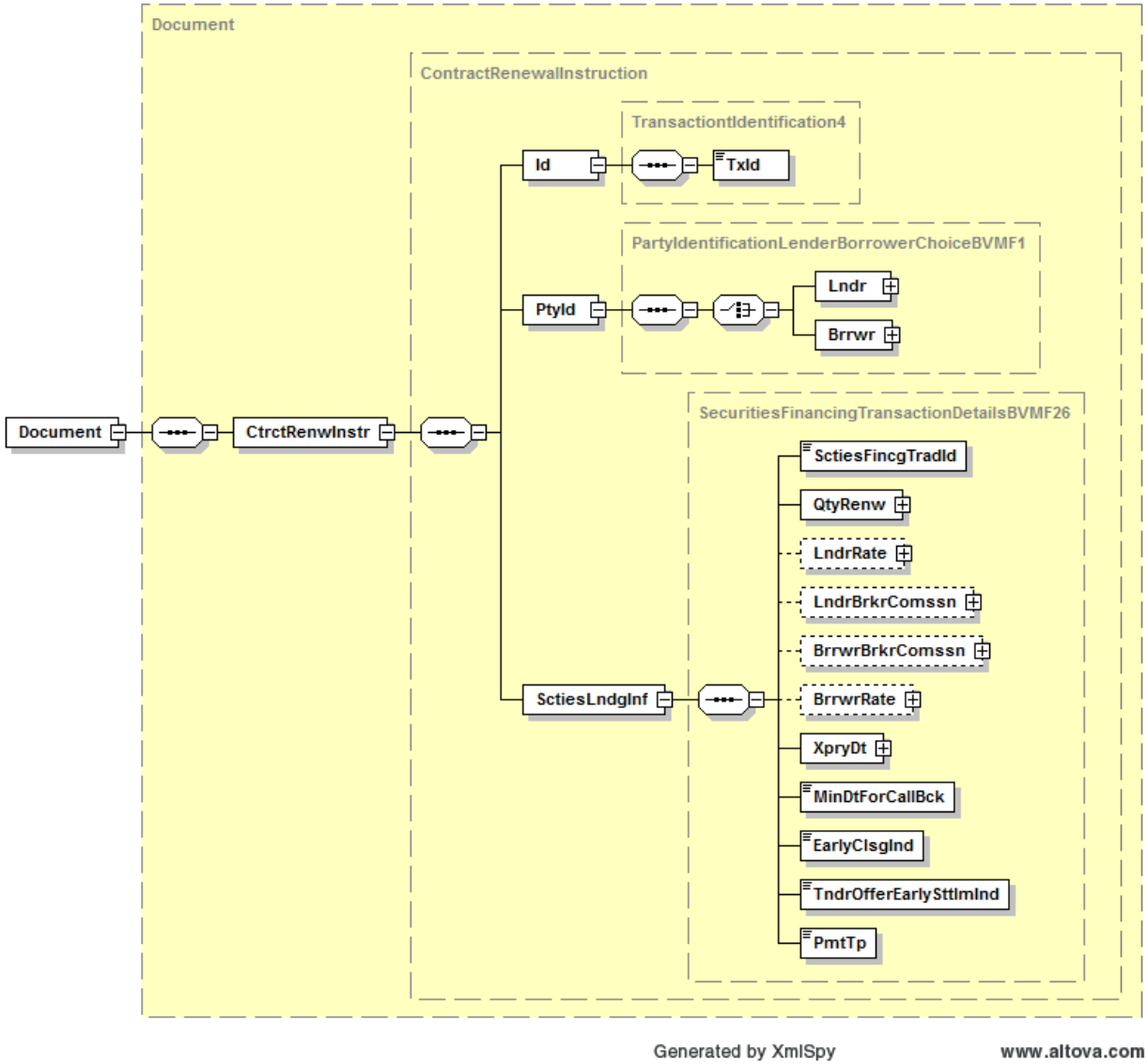
bvmf.130.01 - ContractRenewalInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractRenewalInstruction <bvmf.130.02> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno , parte executora da oferta do contrato de aluguel de ativos tanto como doador ou tomador, ou Participante de Liquidação Doador à BM&FBOVESPA, como requisição de renovação do Contrato de Aluguel de Ativos;

Diagrama da Mensagem


Document
ContractRenewalInstruction
TransactionIdentification4
Id
TxId
PartyIdentificationLenderBorrowerChoiceBVMF1
PtyId
Lndr
Brrwr
SecuritiesFinancingTransactionDetailsBVMF26
Document
CtrctRenwlInstr
SctiesLndgInf
SctiesFincgTradId
QtyRenw
LndrRate
LndrBrkrComssn
BrrwrBrkrComssn
BrrwrRate
XpryDt
MinDtForCallBck
EarlyClsgInd
TndrOfferEarlySttlmInd
PmtTp
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1: A quantidade solicitada deve ser igual ou menor que a quantidade atual do contrato original.

R2: Este campo é obrigatório quando a renovação do contrato for solicitada pelo PNP ou PL doador.

R3: Este campo é obrigatório quando a renovação do contrato for solicitada pelo PNP ou PL tomador.

R4: A data de vencimento da renovação do contrato deve ser maior do que a data de vencimento do contrato original.

R5: A data de carência deve ser maior que a data atual.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[1..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identificação única da transação, gerada pelo Participante solicitante.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction as known by the instructing party.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
2.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SecuritiesLendingInformation	SctiesLndgInf	[1..1]	+	Block with the details of the Securities Lending contract.	Bloco com os detalhes do contrato de aluguel de ativos.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
3.2		QuantityRenewal	QtyRenw	[1..1]	+	Quantity that will be renewed.	Quantidade que será renovada.	R1
3.2.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.3		LenderRate	LndrRate	[0..1]	+	Lender contract rate.	Taxa do doador do contrato.	R2

3.3.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.4		LenderBrokerCommission	LndrBrkrComssn	[0..1]	+	Lender contract commission.	Comissão do participante doador do contrato.	R2
3.4.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.5		BorrowerBrokerCommission	BrrwrBrkrComssn	[0..1]	+	Borrower contract commission.	Comissão do participante tomador do contrato.	R3
3.5.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.6		BorrowerRate	BrrwrRate	[0..1]	+	Borrower contract rate, composed by the sum of the lender´s rate and commission.	Taxa do tomador do contrato, composta pela soma da taxa e comissão do doador.	R3
3.6.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.7		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	+	Expiration date of the contract .	Data de vencimento do contrato.	R4
3.7.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
3.8		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[1..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	R5
3.9		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente.	
3.10		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indicador de liquidação antecipada em caso de OPA.	
3.11		PaymentType	PmtTp	[1..1]	ExternalPaymentTypeCode	Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalPaymentTypeCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este atributo identifica a forma de liquidação do negócio. Ex: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

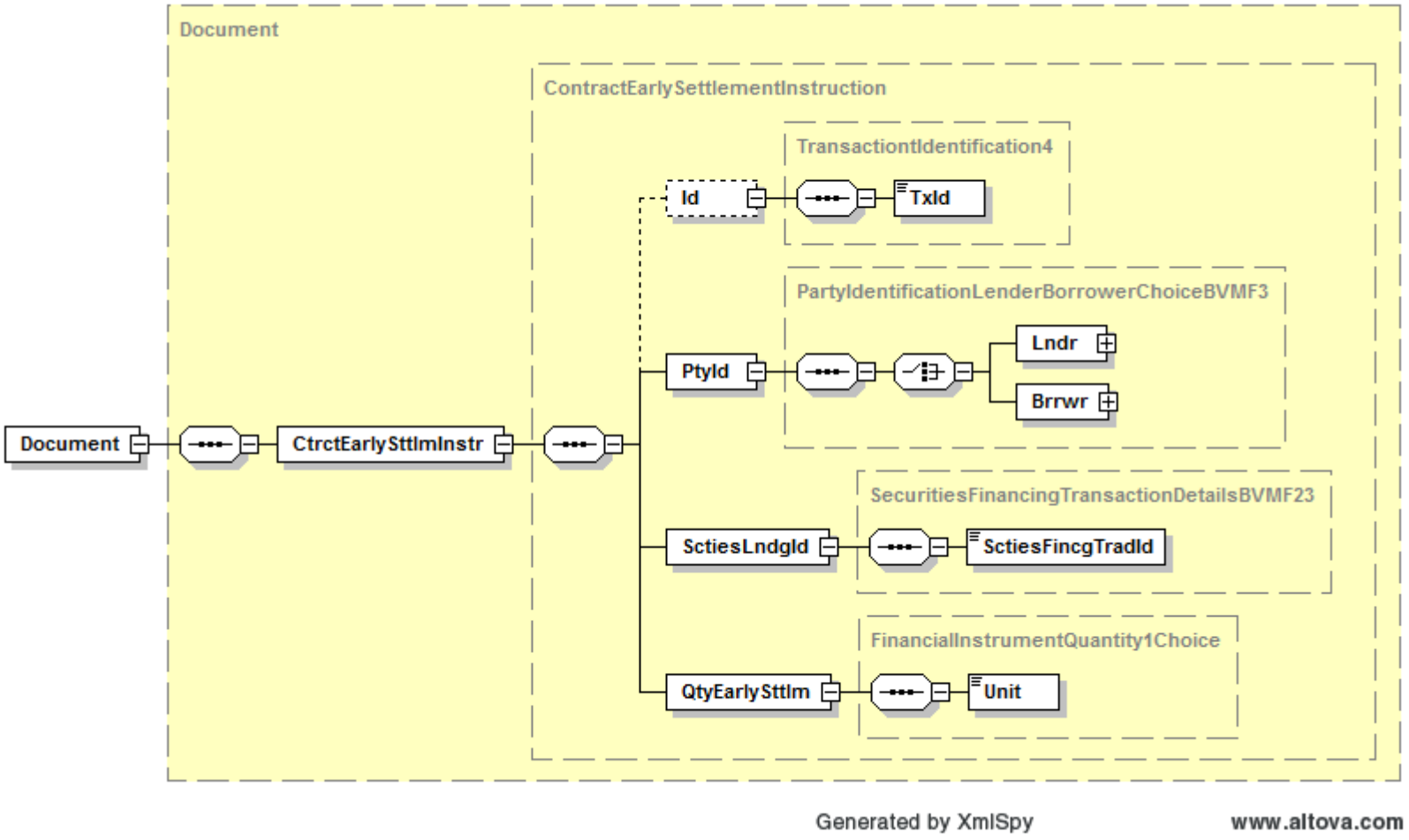
bvmf.131.01 - ContractEarlySettlementInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractEarlySettlementInstruction <bvmf.131.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor das posição do contrato de Aluguel de Ativos à BM&FBOVESPA, como requisição de liquidação antecipada do Contrato de Aluguel de Ativos;

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[0..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identificação única da transação, gerada pelo Participante solicitante.	
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.1.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex:	

						115 = Account Number	115 = Número da Conta	
3.0		SecuritiesLendingIdentification	SctiesLndgId	[1..1]	+	Contract details of the participant.	Detalhes do contrato do participante.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.0		QuantityEarlySettlement	QtyEarlySttlm	[1..1]	+	Quantity to be settled by the Requestor.	Quantidade a ser liquidada pelo participante solicitante.	
4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

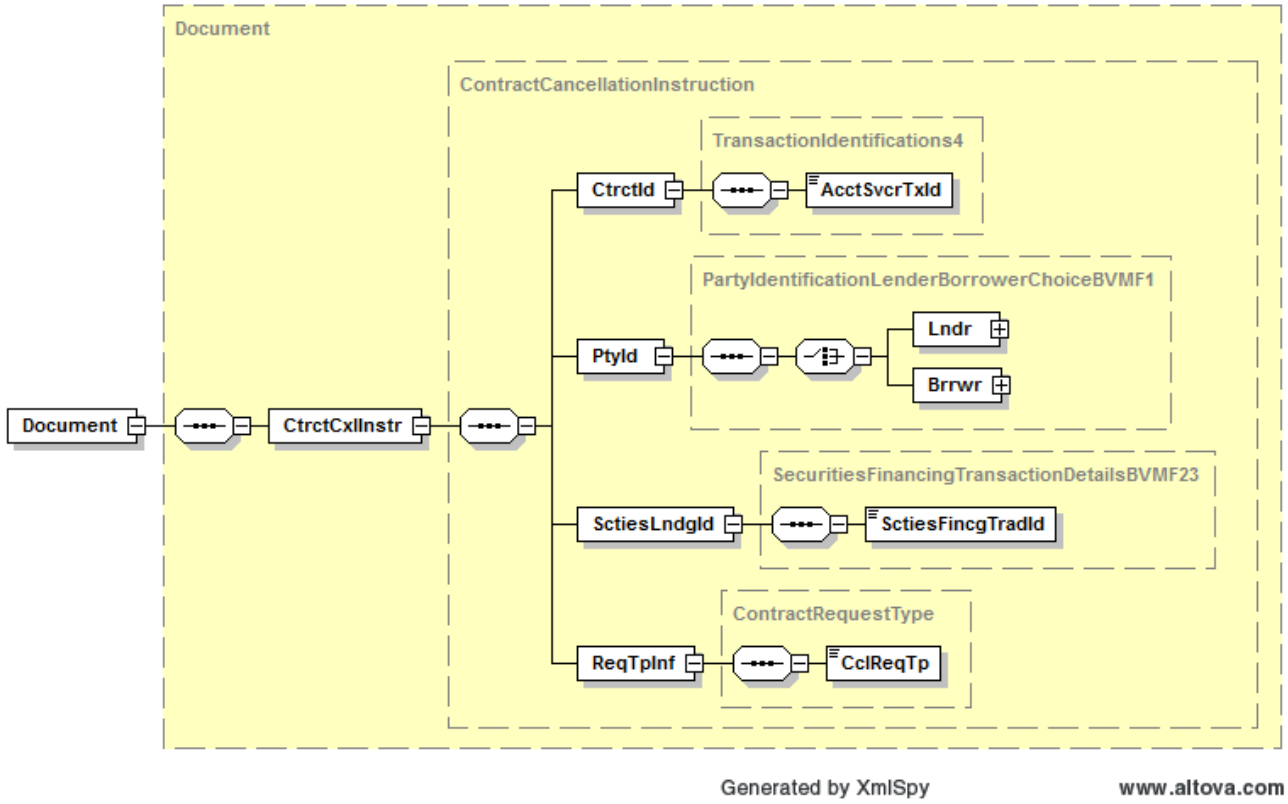
bvmf.132.01 - ContractCancellationInstruction

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractCancellationInstruction <bvmf.132.01> é enviada pelo Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação à BM&FBOVESPA, como requisição de cancelamento de alteração, renovação ou liquidação antecipada do Contrato de BTC;

Diagrama da Mensagem



Regras

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra

1.0		ContractIdentification	CtrctId	[1..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to modification contract, renewal contract or early settlement contract.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a alteração do contrato, renovação do contrato ou liquidação antecipada do contrato.	
1.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	

2.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SecuritiesLendingIdentification	SctiesLndgId	[1..1]	+	Contract details of the participant.	Detalhes do contrato do participante.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.0		RequestTypeInformation	ReqTpInf	[1..1]	+	This block informs the type of request that should be cancelled.	Este bloco informa o tipo de solicitação que poderá ser cancelada.	

4.1		CancelRequestType	CclReqTp	[1..1]	ExternalCancelRequestTypeCode	It indicates what type of request should be cancelled. The "Code" field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is "ExternalCancelRequestTypeCode" in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Informa o tipo de requisição que poderá ser cancelada. Os valores para este campo podem ser consultados nas listas de códigos da BM&FBOVESPA (ExternalCodeLists). Os valores foram registrados em listas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso os valores podem ser obtidos na aba ExternalCancelRequestTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

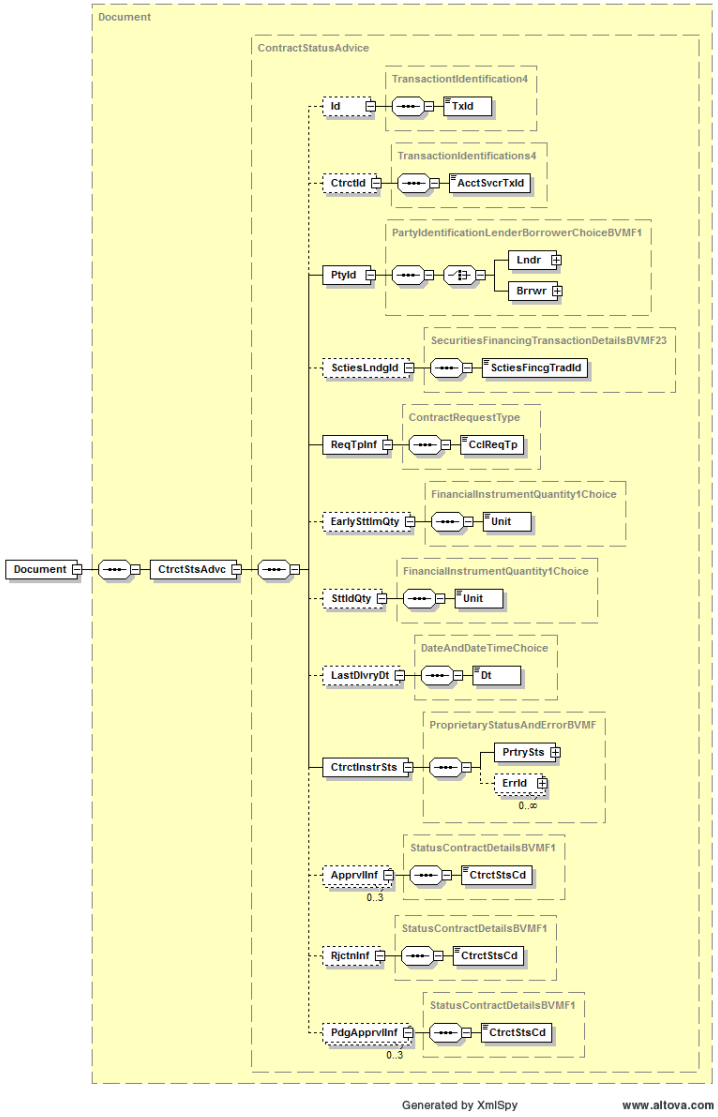
bvmf.133.01 - ContractStatusAdvice

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractStatusAdvice <bvmf.133.01> é enviada pela BM&FBOVESPA aos Participantes informando a situação da alteração, renovação ou liquidação anteciapada de contrato de Aluguel de Ativoss.

Diagrama da Mensagem


Document
ContractStatusAdvice
TransactionIdentification4
Id
TxId
TransactionIdentifications4
CtrctId
AcctSvcrTxId
PartyIdentificationLenderBorrowerChoiceBVMF1
PtyId
Lndr
Brrwr
SecuritiesFinancingTransactionDetailsBVMF23
SctiesLndgId
SctiesFincgTradId
ContractRequestType
ReqTpInf
CclReqTp
FinancialInstrumentQuantity1Choice
EarlySttlmQty
Unit
Document
CtrctStsAdvc
FinancialInstrumentQuantity1Choice
SttldQty
Unit
DateAndDateTimeChoice
LastDlvryDt
Dt
ProprietaryStatusAndErrorBVMF
CtrctInstrSts
PrtrySts
ErrId
0..∞
StatusContractDetailsBVMF1
ApprvlInf
CtrctStsCd
0..3
StatusContractDetailsBVMF1
RjctnInf
CtrctStsCd
StatusContractDetailsBVMF1
PdgApprvlInf
CtrctStsCd
0..3
Generated by XmlSpy
www.altova.com

Regras

R1: Este campo somente deve ser preenchido para o participante que iniciou o fluxo de solicitação

R2: Este campo deve ser preenchido somente quando a solicitação que iniciou o fluxo for para liquidação antecipada.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		Identification	Id	[0..1]	+	Identifies unambiguously the transaction, generated from the requesting Party.	Identificação única da transação, gerada pelo Participante solicitante.	R1
1.1		TransactionIdentification	TxId	[1..1]	Max35Text	Unique transaction ID, known by the participant.	Identificação única da transação, conhecida pelo participante.	
2.0		ContractIdentification	CtrctId	[0..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to modification contract, renewal contract or early settlement contract.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a alteração do contrato, renovação do contrato ou liquidação antecipada do contrato.	
2.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	
3.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
3.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
3.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		SecuritiesLendingIdentification	SctiesLndgId	[0..1]	+	Contract details of the participant.	Detalhes do contrato do participante.	
4.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
5.0		RequestTypeInformation	ReqTpInf	[1..1]	+	This block informs the type of request that should be cancelled.	Este bloco informa o tipo de solicitação que poderá ser cancelada.	

5.1		CancelRequestType	CclReqTp	[1..1]	ExternalCancelRequestTypeCode	It indicates what type of request should be cancelled. The "Code" field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is "ExternalCancelRequestTypeCode" in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Informa o tipo de requisição que poderá ser cancelada. Os valores para este campo podem ser consultados nas listas de códigos da BM&FBOVESPA (ExternalCodeLists). Os valores foram registrados em listas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso os valores podem ser obtidos na aba ExternalCancelRequestTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
6.0		EarlySettlementQuantity	EarlySttlmQty	[0..1]	+	Quantity of assets to be early settled.	Quantidade de ativos a serem liquidados antecipadamente.	R2
6.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
7.0		SettledQuantity	SttldQty	[0..1]	+	Quantity of assets settled.	Quantidade de ativos liquidados.	
7.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
8.0		LastDeliveryDate	LastDlvryDt	[0..1]	+	Deadline for delivery of assets.	Data limite para entrega dos ativos.	R2
8.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
9.0		ContractInstructionStatus	CtrctInstrSts	[1..1]	+	This block contains information on the status (Modification, Renewal, Settlement or Cancelation) of the contract.	Este bloco contém informações da situação da solicitação (Alteração, Renovação, Liquidação ou Cancelamento) do Contrato.	
9.1		ProprietaryStatus	PrtrySts	[1..1]	+	Status information related to the request.	Informações da situação relacionada a solicitação.	
9.1.1		StatusCode	StsCd	[1..1]	Max10Text	Provides a proprietary status of each processing requested. This field requires an external code list. These codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external file is ExternalContractInstructionStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação proprietária da situação de cada processamento solicitado na mensagem. Este campo requer uma lista de códigos externos. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalContractInstructionStatusCode localizado no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
9.2		ErrorIdentification	ErrId	[0..*]	+	Block with error information generated.	Bloco com informação do erro gerado.	
9.2.1		RuleIdentification	RuleId	[1..1]	Max10Text	Code identification related to the rule that was violated by the rejected message.	Código da regra que foi violada causando a rejeição da mensagem de origem.	
10.0		ApprovalInformation	ApprvlInf	[0..3]	+	Provides information about the approvals process renewal, cancellation or early settlement of the Contract.	Fornece informações sobre aprovações no processo renovação, alteração, cancelamento ou liquidação antecipada do Contrato .	
10.1		ContractStatusCode	CtrctStsCd	[1..1]	Max10Text	The purpose of this field is to keep the participants updated on the status (Approval, Rejection and Pending Approval) of the transaction. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from	O objetivo deste campo é manter os participantes atualizados sobre o status (aprovação, rejeição e aprovação pendente) da transação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o	

						BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalContractStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	externo é ExternalContractStatusCode. no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
11.0		RejectionInformation	RjctnInf	[0..1]	+	Provides information about the rejection in the process of renewal, cancellation or early settlement of the contract.	Fornece informações sobre rejeição nos processos de renovação, alteração, cancelamento ou liquidação antecipada do Contrato.	
11.1		ContractStatusCode	CtrctStsCd	[1..1]	Max10Text	The purpose of this field is to keep the participants updated on the status (Approval, Rejection and Pending Approval) of the transaction. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalContractStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	O objetivo deste campo é manter os participantes atualizados sobre o status (aprovação, rejeição e aprovação pendente) da transação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalContractStatusCode. no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
12.0		PendingApprovalInformation	PdgApprvlInf	[0..3]	+	Provides information about pending approvals in the process of renewal, cancellation or early settlement of the Contract.	Fornece informações sobre aprovações pendentes nos processos de renovação, alteração, cancelamento ou liquidação antecipada do Contrato.	
12.1		ContractStatusCode	CtrctStsCd	[1..1]	Max10Text	The purpose of this field is to keep the participants updated on the status (Approval, Rejection and Pending Approval) of the transaction. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalContractStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	O objetivo deste campo é manter os participantes atualizados sobre o status (aprovação, rejeição e aprovação pendente) da transação. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalContractStatusCode. no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

bvmf.134.01 - ContractModificationAdvice

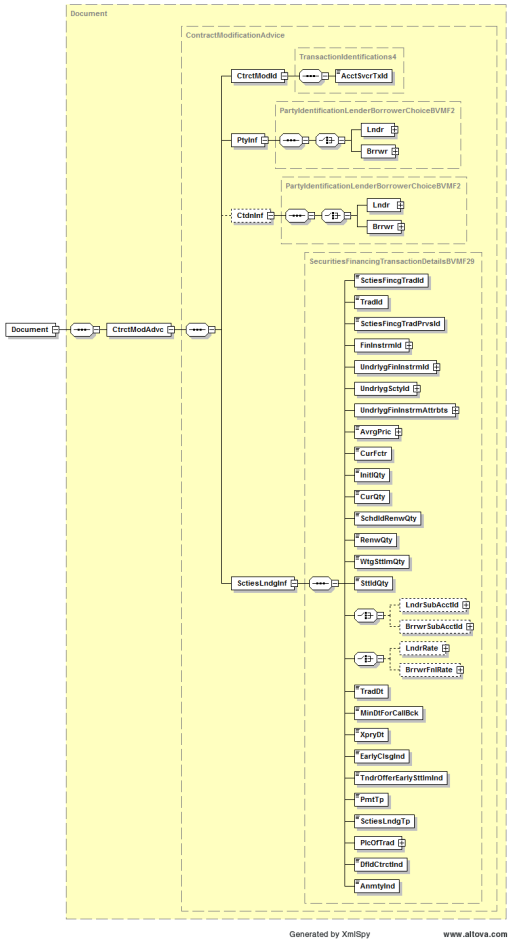
Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractModificationAdvice <bvmf.134.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno ou Participante de Liquidação detentor da posição de aluguel de ativos, como requisição para aprovação de alteração de contrato de aluguel.

Também é enviado ao Custodiante Destino para aprovação de troca de custodiante.
Esta mensagem também é utilizada para informar a alteração de contrato aos participantes que não necessitam participar do fluxo de aprovação.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1: Visível somente para o Custodiante Doador.
R2: Visível somente para o Custodiante Tomador.
R3: Este campo deve ser preenchido somente quando a solicitação que iniciou o fluxo for para liquidação antecipada.

R4: Esta mensagem será sempre informativa quando destinada ao Custodiante Origem.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ContractModificationIdentification	CtrctModId	[1..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to modification contract.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a alteração do contrato.	
1.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	
2.0		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	This block contains the participant and account identification.	Este bloco contém a identificação do participante e conta.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	This block contains the lender party and account identification.	Fornece detalhes sobre a identificação e conta do participante doador.	R1
2.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

2.1.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	This block contains the borrower party and account identification.	Fornece detalhes sobre a identificação e conta do participante tomador.	R2
2.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

2.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.0		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Identifies the Custodian ID code and the Custodian Account ID.	Contém as informações do agente de custódia e da conta de custódia.	
3.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	This block contains the lender party and account identification.	Fornece detalhes sobre a identificação e conta do participante doador.	R1
3.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
3.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.1.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

3.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.1.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
3.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	This block contains the borrower party and account identification.	Fornece detalhes sobre a identificação e conta do participante tomador.	R2
3.2.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Identification of the participant who has the account.	Identificação do participante que possui a conta.	
3.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2.2		AccountIdentification	AcctId	[0..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	

3.2.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
3.2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.0		SecuritiesLendingInformation	SctiesLndgInf	[1..1]	+	Block with the details of the Securities Lending contract.	Bloco com detalhes do contrato de aluguel de ativos.	
4.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification	Número do negócio.	
4.3		SecuritiesFinancingTradePreviousIdentification	SctiesFincgTradPrvsId	[1..1]	Max35Text	Previous contract number.	Identificação anterior do contrato de aluguel de ativos.	
4.4		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides Financial Instrument Identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro.	
4.4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
4.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
4.4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
4.4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
4.4.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
4.4.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
4.5		UnderlyingFinancialInstrumentIdentification	UndrlygFinInstrmId	[1..1]	+	Provides underlying financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro subjacente.	

4.5.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
4.5.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
4.5.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
4.5.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
4.5.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
4.5.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
4.6		UnderlyingSecurityIdentification	UndrlygSctyId	[1..1]	+	This block contains the underlying ticker symbol.	Este bloco contém informações de código de negociação (subjacente).	
4.6.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
4.7		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Características do instrumento financeiro subjacente.	
4.7.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência.	

							d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle.	
4.7.2		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
4.8		AveragePrice	AvrgPric	[1..1]	ActiveOrHistoricCurrencyAnd13DecimalAmount	Average reference price.	Preço médio de referência.	
4.9		CurrentFactor	CurFctr	[1..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	
4.10		InitialQuantity	InitlQty	[1..1]	DecimalNumber	Initial quantity.	Quantidade inicial do contrato.	
4.11		CurrentQuantity	CurQty	[1..1]	DecimalNumber	Current quantity.	Quantidade atual do contrato.	
4.12		ScheduledRenewalQuantity	SchdldRenwQty	[1..1]	DecimalNumber	Scheduled renew quantity.	Quantidade em renovação do contrato.	
4.13		RenewalQuantity	RenwQty	[1..1]	DecimalNumber	Renewed quantity.	Quantidade renovação solicitada do contrato.	
4.14		WaitingSettlementQuantity	WtgSttlmQty	[1..1]	DecimalNumber	Waiting settlement quantity.	Quantidade em Liquidação	
4.15		SettledQuantity	SttldQty	[1..1]	DecimalNumber	Settled quantity.	Quantidade liquidada contrato.	
4.16	OR}	LenderSubAccountIdentification	LndrSubAcctId	[0..1]	+	Provides the lender subaccount identification in the depository.	Fornece a identificação da carteira do doador na depositária.	R1
4.16.1		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
4.17	{OR	BorrowerSubAccountIdentification	BrrwrSubAcctId	[0..1]	+	Provides the borrower subaccount identification in the depository.	Fornece a identificação da carteira do tomador na depositária.	R2
4.17.1		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
4.18	OR}	LenderRate	LndrRate	[0..1]	+	Lender contract rate.	Taxa do doador do contrato.	R1
4.18.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
4.19	{OR	BorrowerFinalRate	BrrwrFnlRate	[0..1]	+	Final Rate = Lender rate + lender broker commission + borrower broker commission.	Taxa final = Taxa do doador+ Comissão do doador + Comissão do tomador.	R2
4.19.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRat	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	

					e			
4.20		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the trade date.	Fornece a data da negociação.	
4.21		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[1..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	
4.22		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	ISODate	Expiration date of the contract.	Data de vencimento do contrato.	
4.23		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente.	
4.24		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indicador de liquidação antecipada em caso de OPA.	R3
4.25		PaymentType	PmtTp	[1..1]	ExternalPaymentTypeCode	Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalPaymentTypeCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este atributo identifica a forma de liquidação do negócio. Ex: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.26		SecuritiesLendingType	SctiesLndgTp	[1..1]	ExternalSecuritiesLendingTypeCode	Securities lending type. This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalSecuritiesLendingTypeCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Tipo de contrato de aluguel de ativos. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecuritiesLendingTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
4.27		PlaceOfTrade	PlcOfTrad	[1..1]	+	Place at which the security is traded.	Este bloco identifica o ambiente de negociação onde o negócio foi executado. Este bloco é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	

4.27.1		Type	Tp	[1..1]	+	This block is not used by BM&FBOVESPA. See “Code” field in the default value of this field.	Este bloco não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Veja no campo Code o valor default deste campo.	
4.27.1.1		Code	Cd	[1..1]	MarketType2Code	This field is not used by the BM&FBOVESPA. It should be filled with the default value = EXCH.	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o default = EXCH.	
4.28		DefaultedContractIndicator	DfldCtrctInd	[1..1]	YesNoIndicator	Defaulted contract indicator.	Indicador de contrato padrão.	
4.29		AnonymityIndicator	AnmtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Anonymous contract indicator.	Indicador de contrato anônimo.	

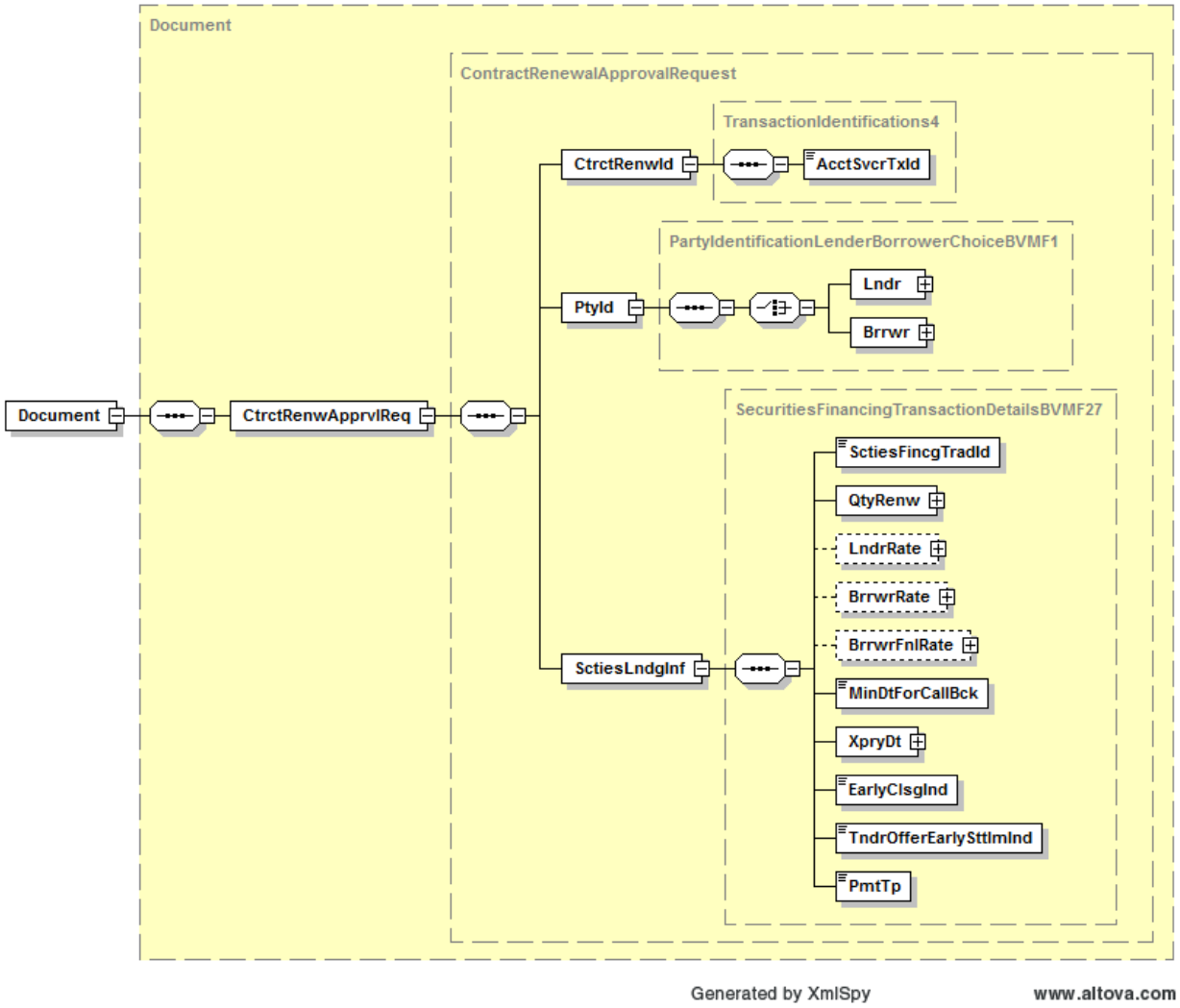
bvmf.135.01 - ContractRenewalApprovalRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractRenewalApprovalRequest <bvmf.135.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno -executor da oferta do contrato de aluguel de ativos ou Participante de Liquidação Doador e Custodiantes, como requisição para aprovação da renovação do contrato de Aluguel de Ativos;

Diagrama da Mensagem



Regras

R1: Este campo deve ser enviado somente para o custodiante doador.
R2: Este campo deve ser enviado somente para o participante contraparte.
R3: Este campo deve ser enviado somente para o custodiante tomador.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ContractRenewalIdentification	CtrctRenwId	[1..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to renewal agreement.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a renovação do contrato.	
1.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
2.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SecuritiesLendingInformation	SctiesLndgInf	[1..1]	+	Block with the details of the Securities Lending contract.	Bloco com os detalhes do contrato de aluguel de ativos.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
3.2		QuantityRenewal	QtyRenw	[1..1]	+	Quantity that will be renewed.	Quantidade que será renovada.	
3.2.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	
3.3		LenderRate	LndrRate	[0..1]	+	Lender contract rate	Taxa do doador do contrato.	R1
3.3.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.4		BorrowerRate	BrrwrRate	[0..1]	+	Borrower contract rate, composed by the sum of the lender´s rate and commission.	Taxa do tomador do contrato, composta pela soma da taxa e comissão do doador.	R2
3.4.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.5		BorrowerFinalRate	BrrwrFnlRate	[0..1]	+	Final Rate = Lender rate + lender broker commission + borrower broker commission.	Taxa final = Taxa do doador+ Comissão do doador + Comissão do tomador	R3

3.5.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
3.6		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[1..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	
3.7		ExpiryDate	XpryDt	[1..1]	+	Expiration date of the contract.	Data de vencimento do contrato.	
3.7.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
3.8		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente.	
3.9		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indicador de liquidação antecipada em caso de OPA.	
3.10		PaymentType	PmtTp	[1..1]	ExternalPaymentTypeCode	Specifies how the transaction is to be settled, for example, 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalPaymentTypeCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Este atributo identifica a forma de liquidação do negócio. Ex: 0 - Netting 1 - Gross 2 - Without Financial Transfer 3 - Between Parts Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalPaymentTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

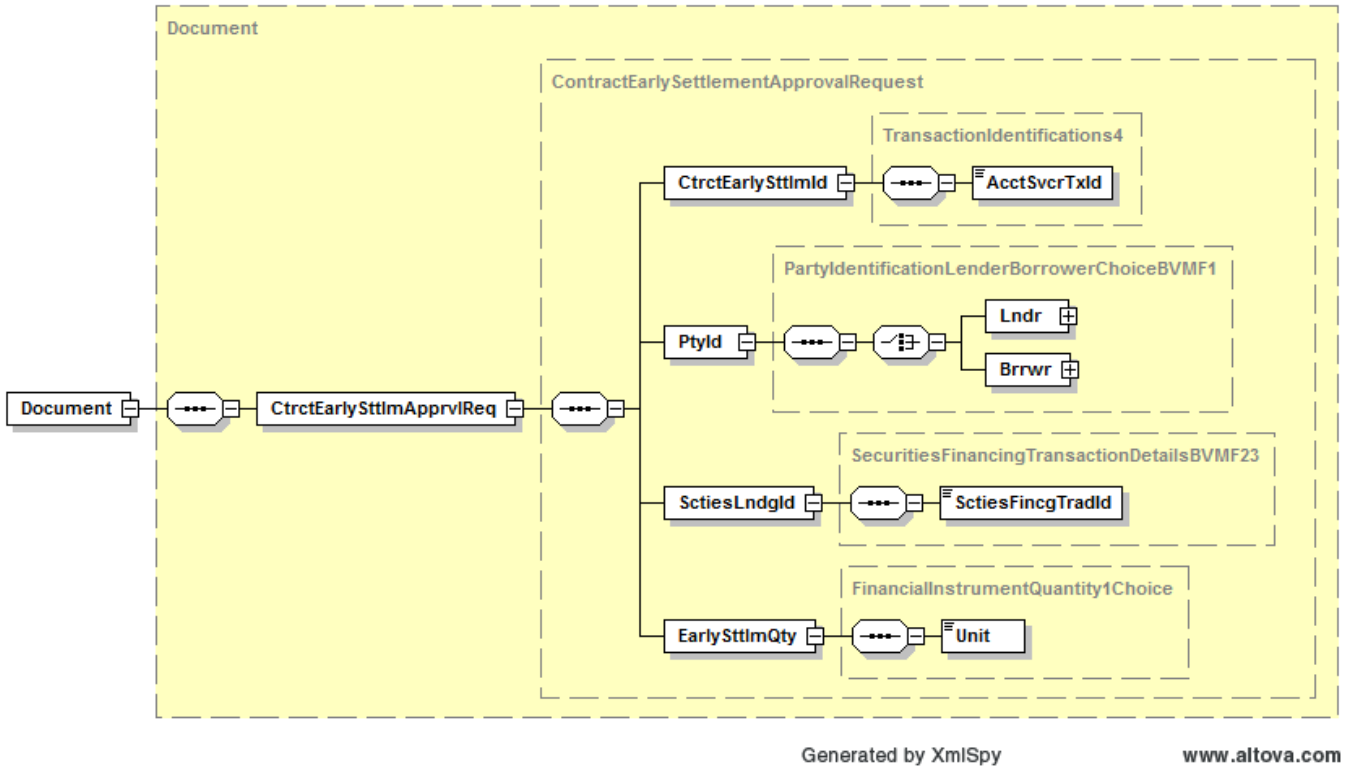
bvmf.136.01 - ContractEarlySettlementApprovalRequest

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractEarlySettlementApprovalRequest <bvmf.136.01> é enviada pela BM&FBOVESPA ao Custodiante Tomador solicitando a aprovação da liquidação antecipada do contrato de Aluguel de Ativos;

Diagrama da Mensagem



Regras

N/A

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ContractEarlySettleme	CtrctEarlySttl	[1..1]	+	Unique transaction ID generated by the	Identificação única da transação, gerada pela	

		ntIdentification	mId			BM&FBOVESPA to early setttlement contract. .	BM&FBOVESPA para a liquidação antecipada do contrato.	
1.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
2.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas	

						spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SecuritiesLendingIdentification	SctiesLndgId	[1..1]	+	Contract details of the participant.	Detalhes do contrato do participante.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.0		EarlySettlementQuantity	EarlySttlmQty	[1..1]	+	Quantity of assets to be early settled.	Quantidade de ativos a serem liquidados antecipadamente.	
4.1		Unit	Unit	[1..1]	DecimalNumber	Quantity expressed as a number.	Quantidade expressa em um valor numérico.	

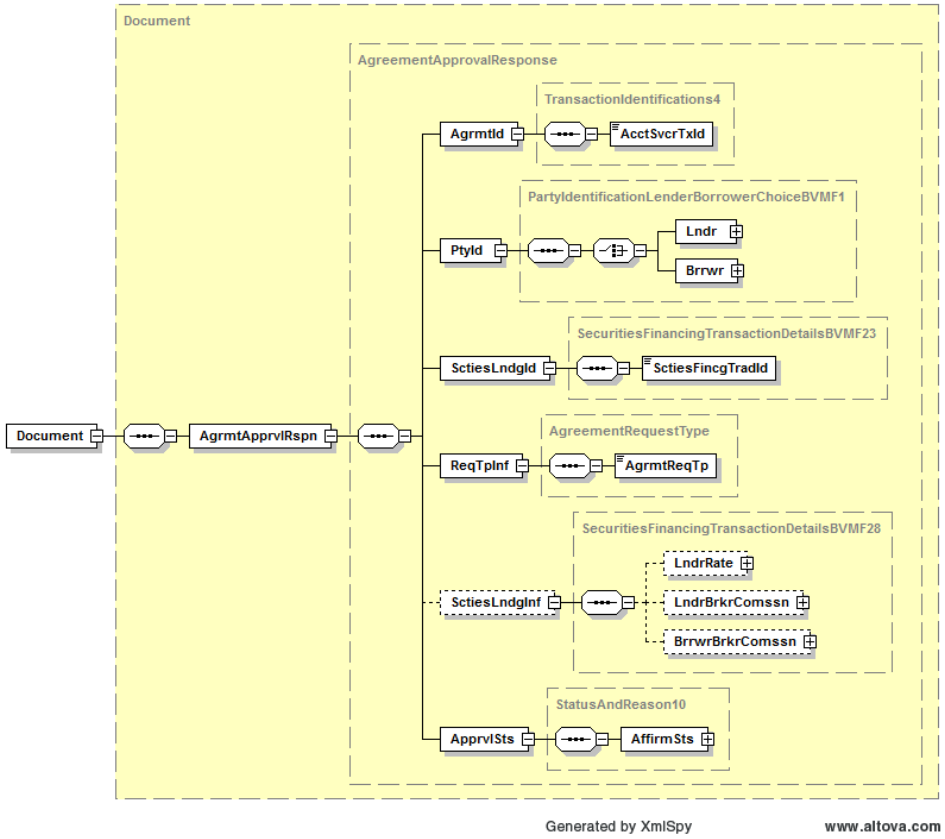
bvmf.138.01 - ContractApprovalResponse

Funcionalidade da Mensagem

Escopo

A mensagem ContractApprovalResponse <bvmf.138.01> é enviada pelos Participantes à BM&FBOVESPA, com a aprovação ou rejeição da alteração, renovação ou liquidação anteciapada de contrato de Aluguel de Ativos.

Diagrama da Mensagem



Regras

R1: Necessário ser preenchido pelo participante doador se o fluxo de renovação for iniciado pelo tomador.
Apenas aplicável para a aprovação de renovação de contrato.

R2: Necessário ser preenchido pelo participante tomador se o fluxo de renovação for iniciado pelo doador. Apenas aplicável para a aprovação de renovação de contrato.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ContractIdentification	CtrctId	[1..1]	+	Unique transaction ID generated by the BM&FBOVESPA to renewal contract.	Identificação única da transação, gerada pela BM&FBOVESPA para a renovação do contrato.	
1.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction.	Identificação inequívoca da transação	
2.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
2.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
2.2.1		ProprietaryIdentificatio	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to	Identificação única atribuída a uma instituição usando	

		n				a financial institution using a proprietary identification scheme.	um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.0		SecuritiesLendingIdentification	SctiesLndgId	[1..1]	+	Contract details of the participant.	Detalhes do contrato do participante.	
3.1		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.0		RequestTypeInformation	ReqTpInf	[1..1]	+	This block informs the type of request that should be cancelled.	Este bloco informa o tipo de solicitação que poderá ser cancelada.	
4.1		CancelRequestType	CclReqTp	[1..1]	ExternalCancelRequestTypeCode	It indicates what type of request should be cancelled. The "Code" field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external is "ExternalCancelRequestTypeCode" in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Informa o tipo de requisição que poderá ser cancelada. Os valores para este campo podem ser consultados nas listas de códigos da BM&FBOVESPA (ExternalCodeLists). Os valores foram registrados em listas externas para permitir a manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso os valores podem ser obtidos na aba ExternalCancelRequestTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

5.0		SecuritiesLendingInformation	SctiesLndgInf	[0..1]	+	Block with the details of the Securities Lending contract.	Bloco com os detalhes do contrato de aluguel de ativos.	
5.1		LenderRate	LndrRate	[0..1]	+	Lender contract rate.	Taxa do doador do contrato.	R1
5.1.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
5.2		LenderBrokerCommission	LndrBrkrComssn	[0..1]	+	Lender contract commission.	Comissão do participante doador do contrato.	R1
5.2.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
5.3		BorrowerBrokerCommission	BrrwrBrkrComssn	[0..1]	+	Borrower contract commission.	Comissão do participante tomador do contrato.	R2
5.3.1		Rate	Rate	[1..1]	PercentageRate	Value is expressed as a rate.	Valor expresso como uma taxa	
6.0		ApprovalStatus	ApprvlSts	[1..1]	+	This block contains information about approval or rejection of the request (Modification, Renewal, Settlement or Cancellation) of the contract.	Este bloco contém as informações da aprovação ou rejeição de determinada solicitação (Alteração, Renovação, Liquidação ou Cancelamento) de contrato.	
6.1		AffirmationStatus	AffirmSts	[1..1]	+	This block contains information on acceptance or rejection of the transaction.	Este bloco contém informação do aceite ou rejeição da transação.	
6.1.1		Code	Cd	[1..1]	AffirmationStatus1Code	AFFI: Acceptance NAFI: Rejection	AFFI: Aceito NAFI: Rejeitado	

BVBG.061.01 - ContractModificationReport

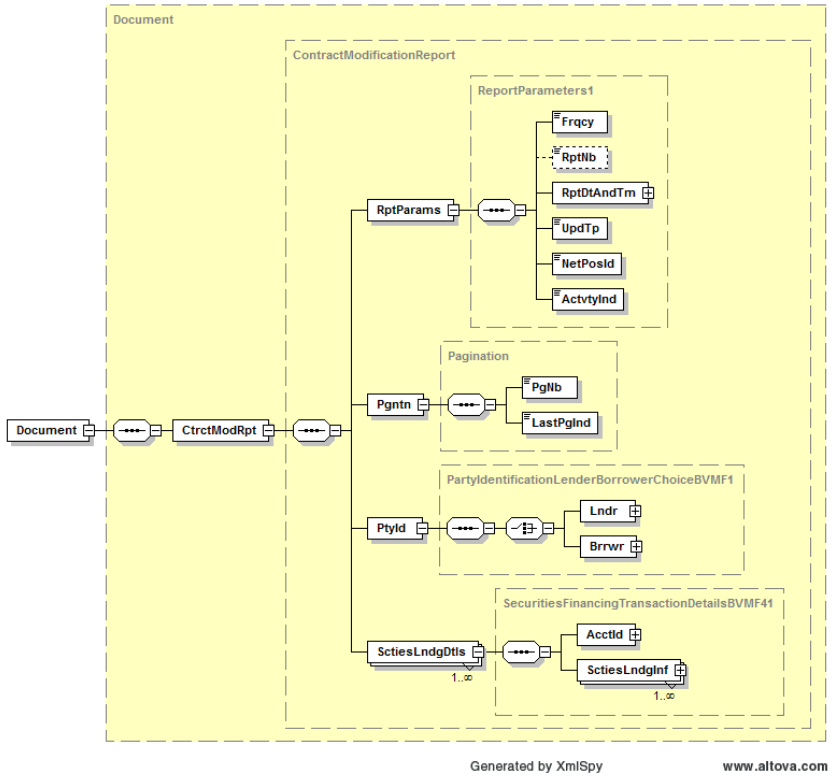
Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo ContractModificationReport <BVBG.061.01> é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante de Negociação Pleno, Participante de Liquidação e/ou Custodiantes para informar os contratos alterados.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “ContractModificationReport” (BVBG.061.01) é composto pela mensagem “ContractModificationReport” (bvmf.139.01).



Regras

N/A.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra

1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Provides the report parameters.	Fornece parâmetros usados na geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
2.0		Pagination	Pgntn	[1..1]	+	Page number of the message (within a statement) and continuation indicator to indicate that the statement is to continue or that the message is the last page of the statement.	Número de página da mensagem (dentro de uma instrução) e indicador de continuação para indicar que a declaração é para continuar ou que a mensagem é a última página da instrução.	
2.1		PageNumber	PgNb	[1..1]	Max5NumericText	Page number.	Número da página.	
2.2		LastPageIndicator	LastPgInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates the last page.	Indica se é a última página do relatório.	

3.0		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes da identificação do participante.	
3.1	{OR	Lender	Lndr	[1..1]	+	Provides details about the lender party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante doador.	
3.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
3.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
3.2	OR}	Borrower	Brrwr	[1..1]	+	Provides details about the borrower party identification.	Fornece detalhes sobre a identificação do participante tomador.	
3.2.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	

3.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
3.2.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
3.2.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.0		SecuritiesLendingDetails	SctiesLndgDtls	[1..*]	+	Block with the details of the Securities Lending contract.	Bloco com os detalhes do contrato de aluguel de ativos.	
4.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	

4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2		SecuritiesLendingInformation	SctiesLndgInf	[1..*]	+	Block with the information of the Securities Lending contract.	Bloco com as informações do contrato de aluguel de ativos.	
4.2.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[1..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction generated by the BM&FBOVESPA.	Identificação da transação gerada pela BM&FBOVESPA.	
4.2.2		SecuritiesFinancingTradeIdentification	SctiesFincgTradId	[1..1]	Max35Text	Contract number.	Identificação do contrato de aluguel de ativos.	
4.2.3		UnderlyingSecurityIdentification	UndrlygSctyId	[1..1]	+	This block contains the underlying ticker symbol.	Este bloco contém informações de código de negociação (subjacente).	
4.2.3.1		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação.Ex: BVMF3	
4.2.4		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Caracteríticas do instrumento financeiro subjacente.	

4.2.4.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle.	
4.2.4.2		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
4.2.5		CurrentQuantity	CurQty	[1..1]	DecimalNumber	Current quantity.	Quantidade atual do contrato.	
4.2.6		SecuritiesLendingPrevious	SctiesLndgPrvs	[1..1]	+	Block with information change of previous contract.	Bloco com informações do contrato antes da alteração.	
4.2.6.1		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente pelo doador.	
4.2.6.2		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[0..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indicador de liquidação antecipada pelo doador em caso de OPA.	

4.2.6.3		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[0..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	
4.2.6.4		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
4.2.6.4.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
4.2.6.4.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.6.4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

4.2.6.4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.2.6.4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.2.6.4.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.6.4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.6.4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.6.5		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
4.2.7		SecuritiesLendingCurrent	SctiesLndgCur	[1..1]	+	Block with the new contract data.	Bloco com as novos dados do contrato.	
4.2.7.1		EarlyClosingIndicator	EarlyClsgInd	[0..1]	YesNoIndicator	It indicates whether the contract can or can not be settled before the expiry date.	Indica se o contrato pode ou não ser liquidado antecipadamente pelo doador.	
4.2.7.2		TenderOfferEarlySettlementIndicator	TndrOfferEarlySttlmInd	[0..1]	YesNoIndicator	Indicator of early settlement in the case of Tender Offer.	Indicador de liquidação antecipada pelo doador em caso de OPA.	

4.2.7.3		MinimumDateForCallBack	MinDtForCallBck	[0..1]	ISODate	This is the minimum date at which the borrower is not allowed to give back the securities. Additionally this date represents the minimum date when the lender can ask for early settlement and for both sides (lender/borrower) make a renewal request.	Esta é a data mínima (Carência) em que o participante tomador é obrigado a permanecer com o contrato de empréstimo de título aluguel de ativos. A data de carência também é a data mínima para o doador pedir liquidação antecipada e para ambos os lados solicitarem uma renovação.	
4.2.7.4		CustodianInformation	CtdnInf	[0..1]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
4.2.7.4.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
4.2.7.4.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.7.4.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	

4.2.7.4.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
4.2.7.4.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
4.2.7.4.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
4.2.7.4.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
4.2.7.4.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
4.2.7.5		SubAccount	SubAcct	[0..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
4.2.8		ApproveUser	ApprvUsr	[1..1]	Max35Text	User requested the approval of contract modification.	Usuário que solicitou a requisição\aprovação da alteração do contrato.	

BVBG.062.01 - ContractSettlementReport

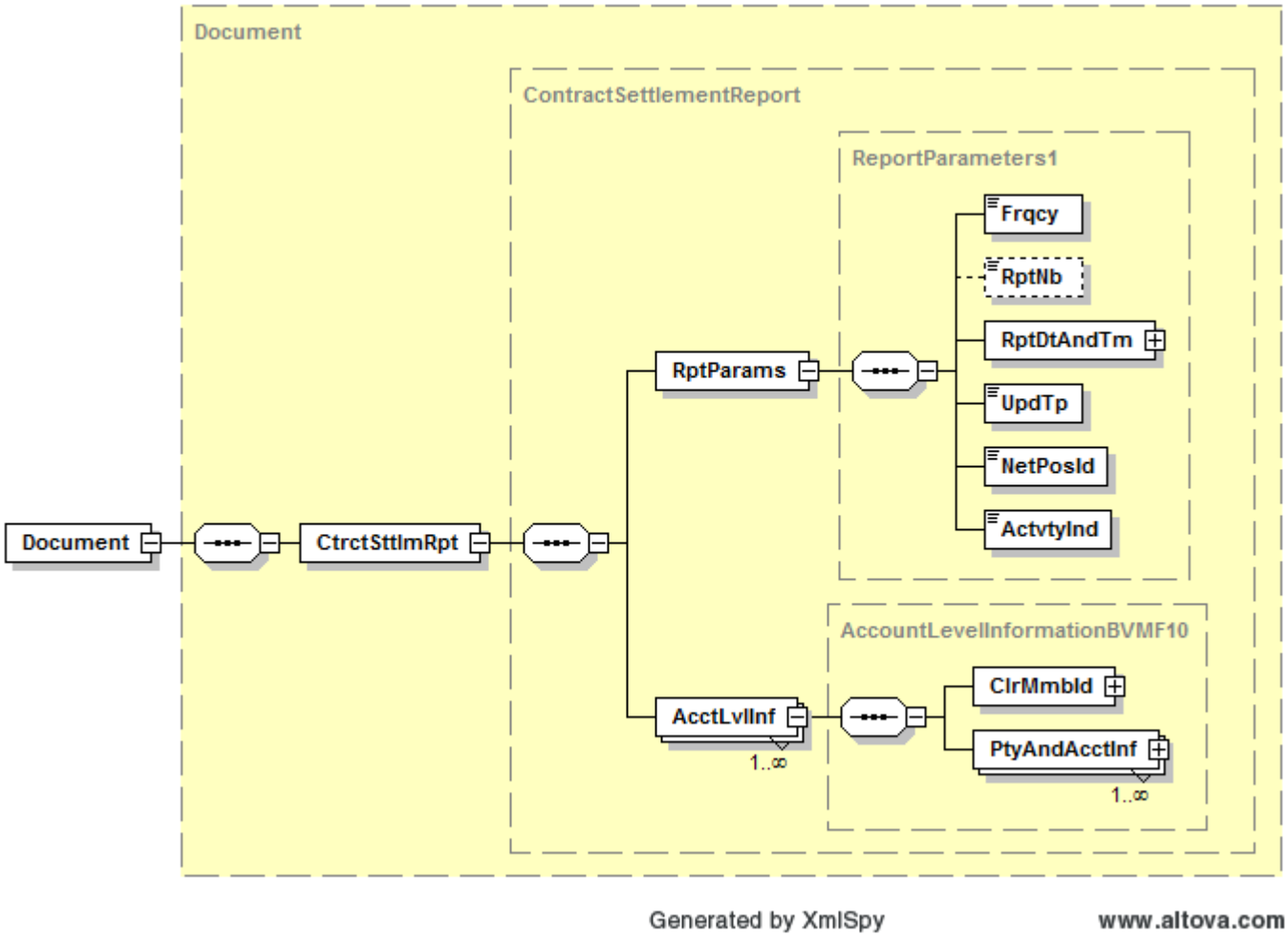
Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo ContractSettlementReport <BVBG.062.01> é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante para informar os contratos de derivativos não fungíveis e de aluguel de ativos que serão liquidados no dia.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “ContractSettlementReport” (BVBG.062.01) é composto pela mensagem “ContractSettlementReport” (bvmf.179.01).



Regras

R1 - Obrigatório para termo de ouro.

R2 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante e custodiante doadores.
R3 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante tomador.
R4 - Isto deverá ser enviado apenas para o partcipante tomador e custodiante tomador.
R5 - Preenchido somente no caso de AnonymityIndicator seja igual a "false".
R6 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante doador.
R7 - Não disponível para liquidação no vencimento.
R8 - Obrigatório somente para termo.
R9 - Obrigatório somente para termo de ações.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Provides the report parameters.	Fornece parâmetros usados na geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	

1.6		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[1..*]	+	Provides account level information	Informação de liquidação de contratos de termo e empréstimo de ativos no nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	

2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndActInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.2.1		CustodianIdentification	CtdnId	[1..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	

2.2.2.2.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2		SafekeepingAccount Information	SfkpgAcctInf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1		SafekeepingAccount Identification	SfkpgAcctId	[1..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.2		SettlementInformation	SttlmInf	[1..*]	+	This block provides the contract settlement information.	Este bloco fornece informações da liquidação do contrato.	

2.2.2.2.2.2.1		AccountServicerTransactionIdentification	AcctSvcrTxId	[0..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the transaction generated by the BM&FBOVESPA.	Identificação da transação gerada pela BM&FBOVESPA.	R7
2.2.2.2.2.2.2		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
2.2.2.2.2.2.3		SideLenderBorrower	SdLndrBrrwr	[1..1]	ExternalSideLenderBorrowerCode	Side of a contract position. This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalSideLenderBorrowerCode ExternalCodeLists_BVMF.xls	Natureza da posição do contrato. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSideLenderBorrowerCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.2.4		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
2.2.2.2.2.2.4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.2.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.2.4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.2.2.4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.2.4.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.2.4.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2.2.5		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains ISIN and Ticker symbol Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN e do Ticker Symbol.	
2.2.2.2.2.2.5.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada	R8

						Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.2.2.5.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, RTR.L for Reuters quoted in London.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação, por exemplo, RTR.L para a Reuters citada em Londres.	
2.2.2.2.2.6		FinancialInstrumentInformation	FinInstrmInf	[1..1]	+	Informations of the elements characterising a financial instrument.	Informações dos elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.2.6.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO	

						10 - Cash 12 - Options exercise (call) 13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL 4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.2.2.6.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.2.2.7		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmA ttrbts	[0..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.2.7.1		DistributionIdentifica tion	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	R9
2.2.2.2.2.8		UnderlyingFinancialI nstrumentIdentificati on	UndrlygFin InstrmId	[1..1]	+	Provides underlying financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro subjacente.	
2.2.2.2.2.8.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.8.1 .1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema	

						system. (Security ID).	Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.8.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.2.8.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.8.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.8.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2.9		UnderlyingSecurityIdentification	UndrlygSctyId	[1..1]	+	This block contains the underlying ticker symbol.	Este bloco contém informações de ISIN e código de negociação (subjacentes).	
2.2.2.2.2.9.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou	

							representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.2.2.9.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.2.2.10		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Caracteríticas do instrumento financeiro (subjacente).	
2.2.2.2.2.10.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.2.2.11		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	ISODate	Date when the contract expires.	Data Expiração do contrato.	
2.2.2.2.2.12		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	
2.2.2.2.2.13		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
2.2.2.2.2.14		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	Provides Trade Information.	Informação sobre a negociação.	
2.2.2.2.2.14.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.2.2.14.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
2.2.2.2.2.14.3		OriginalQuantity	OrgnlQty	[1..1]	DecimalNumber	Provides original quantity information.	Quantidade original.	
2.2.2.2.2.15		SettlementDetails	SttlmDtls	[1..1]	+	Provides details about settlement.	Fornece detalhes sobre a liquidação.	
2.2.2.2.2.15.1		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[0..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward and Securities Lending Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from	Tipo de liquidação de termo e aluguel de ativos. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da	

						BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.2.15.2		EarlySettledQuantity	EarlySttldQty	[1..1]	DecimalNumber	Early Settled quantity.	Quantidade antecipada liquidada contrato.	
2.2.2.2.2.2.15.3		CurrentQuantity	CurQty	[1..1]	DecimalNumber	Current quantity.	Quantidade atual do contrato.	
2.2.2.2.2.2.15.4		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	ISODate	Settlement date.	Data de liquidação.	
2.2.2.2.2.2.15.5		EarlySettlementRequestDate	EarlySttlmReqDt	[0..1]	ISODate	Early settlement request date	Data da solicitação de liquidação.	
2.2.2.2.2.2.15.6		SettlementValue	SttlmVal	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Value that will be settled.	Valor que será liquidado.	
2.2.2.2.2.2.15.7	{OR	ForwardDetails	FwdDtls	[1..1]	+	Provides details about fowards (equities and gold).	Fornece detalhes do contrato de termos (ações e ouro).	
2.2.2.2.2.2.15.7.1		ForwardPrice	FwdPric	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Price of the forward contract.	Preço do contrato a termo.	
2.2.2.2.2.2.15.7.2		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	R1
2.2.2.2.2.2.15.		EquityForwardType	EqtyFwdT	[1..1]	ExternalEquityF	Equity forward type.	Tipo de Termo.	

7.3			p		orwardTypeCode	This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalEquityForwardTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalEquityForwardTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.15.8	OR}	SecuritiesLendingDetails	SctiesLndgDtls	[1..1]	+	Provides detailas about securities lending.	Fornece detalhes sobre os contratos de aluguel de ativos.	
2.2.2.2.2.15.8.1		SecuritiesLendingContractType	SctiesLndgCtrctTp	[0..1]	ExternalSecuritiesLendingContractTypeCode	Securities Lending Contract Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalSecuritiesLendingContractTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de contrato de aluguel de ativos. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecuritiesLendingContractTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.15.8.2		LastPossibleSettlementDate	LastPssblSttlmDt	[0..1]	ISODate	This is the maximum date for settlement of the contract by the borrower.	Esta é a data máxima para liquidação do contrato pelo tomador.	
2.2.2.2.2.15.8.3		WorkdaysBetweenOpeningAndSettlement	WrksBtwnOpngAndSttlm	[0..1]	DecimalNumber	Quantity of workdays between opening the contract and settlement.	Quantidade de dias uteis entre abertura do contrato e liquidação.	
2.2.2.2.2.15.8.4		LenderRate	LndrRate	[0..1]	PercentageRate	Lender contract rate.	Taxa do doador do contrato.	R2
2.2.2.2.2.15.8.5		LenderBrokerCommission	LndrBrkrComssn	[0..1]	PercentageRate	Lender contract commission.	Comissão do doador do contrato.	R6
2.2.2.2.2.15.8.6		LenderFinancialValueRemuneration	LndrFinValRmnrtn	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Financial value to be received by the lender for the rental of its assets during the contract period.	Valor financeiro a ser recebido pelo doador pelo aluguel de seus ativos durante o período de vigência do contrato.	R2
2.2.2.2.2.15.8.7		LenderFinancialValueCommission	LndrFinValComssn	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Financial value to be received by the lender participant as broker commission.	Valor financeiro a ser recebido pelo participante do lado doador, como remuneração do serviço prestado, e conforme vigência do contrato.	R6
2.2.2.2.2.15.8.8		BorrowerRate	BrrwrRate	[0..1]	PercentageRate	Borrower contract rate, composed by the sum of the lender´s rate and commission.	Taxa do tomador do contrato, composta pela soma da taxa e comissão do doador.	R3
2.2.2.2.2.15.8.9		BorrowerBrokerCommission	BrrwrBrkrComssn	[0..1]	PercentageRate	Borrower contract commission.	Comissão do tomador do contrato.	R3

2.2.2.2.2.2.15.8.10		BorrowerFinalRate	BrrwrFnlRate	[0..1]	PercentageRate	Final Rate = Lender rate + lender broker commission + borrower broker commission.	Taxa final da renovação. Composta pela soma da Taxa do Doador, Taxa do Tomador e Comissão do Tomador.	R4
2.2.2.2.2.2.15.8.11		BorrowerFinancialValueCommission	BrrwrFinValComssn	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Financial value to be received by the borrower intermediary participant as broker commission.	Valor financeiro a ser recebido pelo participante do lado tomador, como remuneração do serviço prestado, e conforme vigência do contrato.	R3
2.2.2.2.2.2.15.8.12		BorrowerFinancialValuePaid	BrrwrFinValPd	[0..1]	RestrictedBVMFActiveOrHistoricCurrencyAnd8DecimalAmount	Financial amount to be paid by the borrower for the rent of the assets during the contract period.	Valor financeiro a ser pago pelo tomador pelo aluguel dos ativos durante o período de vigência do contrato.	R4
2.2.2.2.2.2.15.8.13		GiveUpPartyInformation	GvUpPtyInf	[0..1]	+	Provides details about the give up party identification and account.	Fornece detalhes da identificação do participante e conta, origem da indicação.	R2
2.2.2.2.2.2.15.8.13.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.2.2.2.2.15.8.13.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.2.15.8.13.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.2.2.15.8.13.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

2.2.2.2.2.2.15.8.13.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2.2.15.8.13.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.2.2.2.15.8.13.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.2.15.8.13.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.2.15.8.14		AnonymityIndicator	AnmtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Anonymous contract indicator.	Indicador de contrato anônimo.	
2.2.2.2.2.2.15.8.15		CounterPartyIdentification	CntrPtyId	[0..1]	+	Provides details about the counterparty identification.	Fornece detalhes de identificação da contraparte.	R5
2.2.2.2.2.2.15.8.15.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.2.15.8.15.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.2.2.15.8.15.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	

2.2.2.2.2.2.15.8.15.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2.2.15.8.16		UnderlyingPreviousDayClosingPrice	UndrlygPrvsDayClsgPric	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Previous day´s underlying closing price.	Preço de fechamento do dia anterior (subjacente).	

BVBG.063.01 - EarlySettlementReport

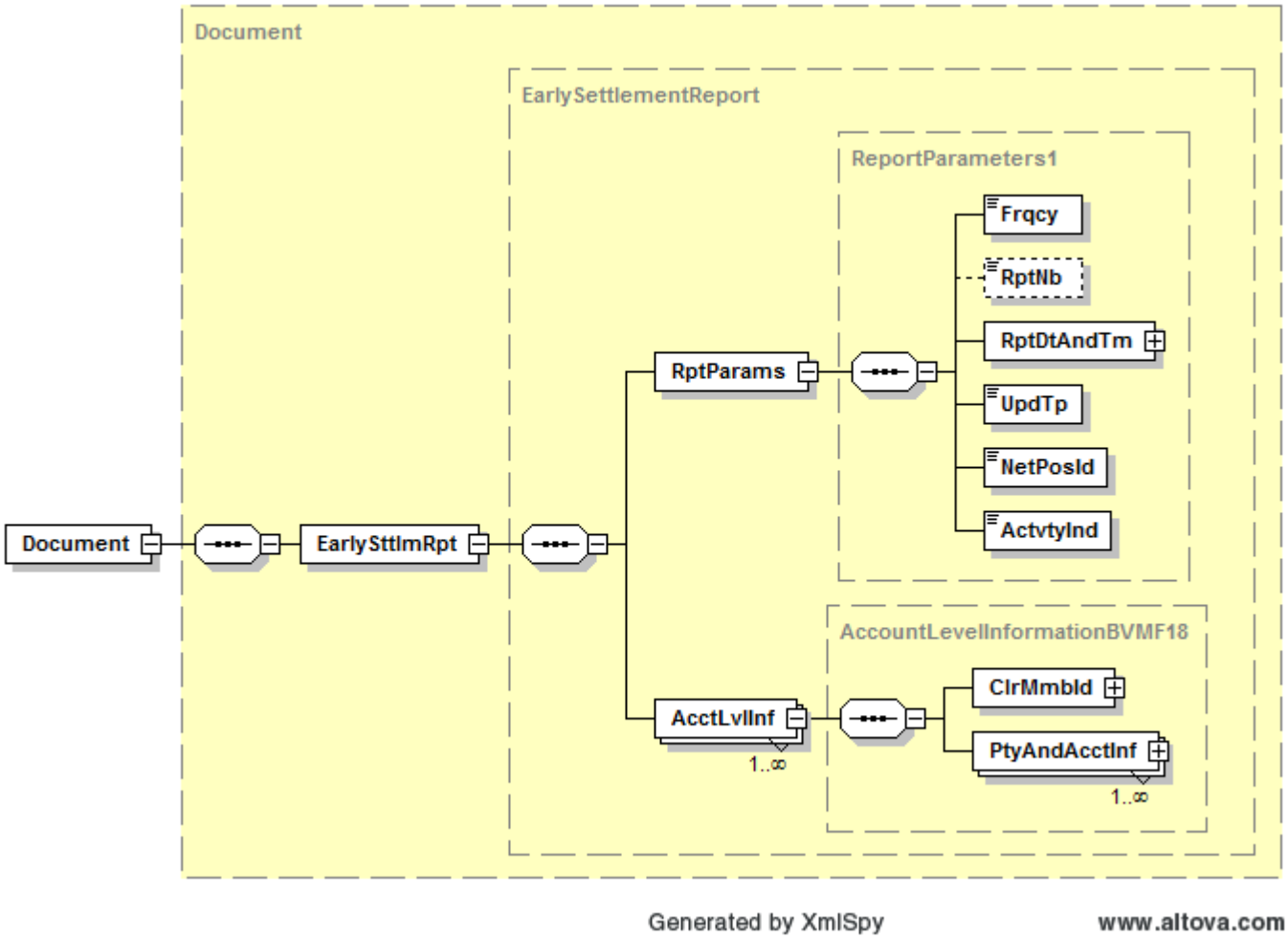
Funcionalidade do Arquivo

Escopo

O arquivo EarlySettlementReport <BVBG.063.01> é enviado pela BM&FBOVESPA ao Participante para informar as liquidações antecipadas dos contratos de derivativos não fungíveis e de aluguel de ativos.
Este arquivo também é enviado como informe das solicitações de liquidações antecipadas.

Diagrama da Mensagem

O arquivo “EarlySettlementReport” (BVBG.063.01) é composto pela mensagem “EarlySettlementRequest” (bvmf.185.01).



Regras

R1 - Obrigatório para termo de ouro.

R2 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante e custodiante doadores.
R3 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante tomador.
R4 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante tomador e custodiante tomador.
R5 - Preenchido somente no caso de AnonymityIndicator seja igual a "false".
R6 - Isto deverá ser enviado apenas para o participante doador.
R7 - Obrigatório somente para termo.
R8 - Obrigatório somente para termo de ações.

Estrutura da Mensagem

INDEX	OR	Message Item	Tag	Mult.	Data Type	Description	Descrição	Regra
1.0		ReportParameters	RptParams	[1..1]	+	Provides the report parameters.	Fornece parâmetros usados na geração do relatório.	
1.1		Frequency	Frqcy	[1..1]	EventFrequency6Code	Frequency of the report. E.g: DAIL - Event takes place every day. ONDE - Event takes place on demand	Informa a regularidade em que o relatório é enviado. Ex: DAIL = Evento que ocorre todo dia. ONDE = Evento que ocorre sobre demanda	
1.2		ReportNumber	RptNb	[0..1]	Exact5NumericText	Sequential number of the report.	Número dado ao relatório.	
1.3		ReportDateAndTime	RptDtAndTm	[1..1]	+	Reference date of the information.	Data de referência da informação.	
1.3.1		Date	Dt	[1..1]	ISODate	Specified date.	Especifica uma data.	
1.4		UpdateType	UpdTp	[1..1]	StatementUpdateType1Code	Indicates whether the statement is complete or contains changes only.This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "COMP".	Indica se o documento é completo ou contém somente alterações. Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "COMP".	
1.5		NetPositionIdentification	NetPosId	[1..1]	Max35Text	This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "XXXX".	Este campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default "XXXX".	
1.6		ActivityIndicator	ActvtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Indicates whether there is activity or information update reported in the	Indica se existe atualização de atividade ou de informação no documento. Este	

						statement. This field is not used by BM&FBOVESPA. This field should be filled with default "true".	campo não é utilizado pela BM&FBOVESPA e deve ser preenchido com o valor padrão "true".	
2.0		AccountLevelInformation	AcctLvlInf	[1..*]	+	Provides account level information	Informação da liquidação antecipada do nível da conta.	
2.1		ClearingMemberIdentification	ClrMmbId	[1..1]	+	Provides clearing member Information.	Informações do membro de compensação.	
2.1.1		ClearingMember	ClrMmb	[1..1]	+	Provides details about the clearing member identification.	Fornece detalhes da identificação do membro de compensação.	
2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier for an organisation that is allocated by an institution.	Identificador único para uma organização que é atribuído por uma instituição.	
2.1.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.1.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.1.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.1.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2		PartyAndAccountInformation	PtyAndActInf	[1..*]	+	This block identifies the party and account.	Este bloco identifica o participante e a Conta .	
2.2.1		PartyInformation	PtyInf	[1..1]	+	Provides details about the party	Fornece detalhes de identificação do	

						identification.	participante.	
2.2.1.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.1.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to an organisation using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.1.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguos identifier as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.1.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação.Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.1.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex.: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2		AccountInformation	AcctInf	[1..*]	+	Provides account information.	Fornece informações da conta.	
2.2.2.1		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides the account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2		CustodianInformation	CtdnInf	[1..*]	+	Provides custodian information.	Fornece informações do custodiante.	
2.2.2.2.1		CustodianIdentification	CtdnId	[1..1]	+	Provides custodian identification.	Fornece dados de identificação do custodiante.	
2.2.2.2.1.1		ProprietaryIdentificat	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as	Identificação única atribuída a uma	

		ion				assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2		SafekeepingAccount Information	SfkpgAcctI nf	[1..*]	+	Provides safekeeping account information.	Fornece informações da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1		SafekeepingAccount Identification	SfkpgAcctI d	[1..1]	+	Provides safekeeping account identification.	Fornece dados para identificação da conta de custódia.	
2.2.2.2.2.1.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account investors. e.g 115 = Account Number	Número de identificação da conta. Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.2		EarlySettlementInfor mation	EarlySttlmI nf	[1..*]	+	This block provides the early settlement information.	Este bloco fornece informações de liquidação antecipada.	
2.2.2.2.2.2.1		AccountServicerTra	AcctSvcrT	[0..1]	Max35Text	Unambiguous identification of the	Identificação da transação gerada pela	

		nsactionIdentification	xId			transaction generated by the BM&FBOVESPA.	BM&FBOVESPA.	
2.2.2.2.2.2		ContractNumber	CtrctNb	[1..1]	int	Contract number.	Número do Contrato.	
2.2.2.2.2.3		SideLenderBorrower	SdLndrBrrwr	[1..1]	ExternalSideLenderBorrowerCode	Nature of the type of contract. This field requires a list of external code. These codes and values were made in external spreadsheets to enable flexible maintenance in accordance with the requirements of the BM&FBOVESPA updates. In this case the external file is in ExternalSideLenderBorrowerCode ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Natureza da posição do contrato. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSideLenderBorrowerCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.4		FinancialInstrumentIdentification	FinInstrmId	[1..1]	+	Provides details about the security identification.	Fornece detalhes da identificação do instrumento.	
2.2.2.2.2.4.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.4.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.4.1.2		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	
2.2.2.2.2.4.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.4.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.4.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2.5		SecurityIdentification	SctyId	[1..1]	+	This block contains ISIN and Ticker symbol Identification.	Este bloco contém a identificação do ISIN e do Ticker Symbol.	
2.2.2.2.2.5.1		ISIN	ISIN	[0..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários	R7

						representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.2.2.5.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, RTR.L for Reuters quoted in London.	Letras que identificam ações negociadas em bolsa de valores. O símbolo é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação, por exemplo, RTR.L para a Reuters citada em Londres.	
2.2.2.2.2.6		FinancialInstrumentInformation	FinInstrmInf	[1..1]	+	Informations of the elements characterising a financial instrument.	Informações dos elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.2.6.1		Market	Mkt	[1..1]	ExternalMarketCode	A Market represents the Second level of market classification in the post trade process. Example: 1 - Spot 2 - Future 3 - Options on Spot 4 - Options on Future 5 - Forward 10 - Cash 12 - Options exercise (call)	Representa o segundo nível da classificação de mercado no processo de pós-negociação. exemplo 1 - MERCADO DISPONIVEL 2 - MERCADO FUTURO 3 - OPCOES SOBRE DISPONIVEL	

						13 - Options exercise (put) 17 - Auction 20 - Odd Lot 30 - Equity Forward 70 - Equity Call 80 - Equity Put This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BVMF. In this case the external is ExternalMarketCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls	4 - OPCOES SOBRE FUTURO 5 - MERCADO TERMO 10 - Vista 12 - Exercício de opções de compra 13 - Exercício de opções de venda 17 - Leilão 20 - Fracionário 30 - Termo de ações 70 - OPC 80 - OPV Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e os valores foram criados em uma planilha externa para permitir uma manutenção flexível de acordo com os requisitos de atualizações da BVMF. Neste caso, o externo é ExternalMarketCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls	
2.2.2.2.2.6.2		Asset	Asst	[1..1]	Max30Text	Asset associated with the security , such as DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	Mercadoria associada ao instrumento. Ex:DOL, BGI, OZ1, WDL, CNI, ICF, CCM, etc.	
2.2.2.2.2.7		FinancialInstrument Attributes	FinInstrmAttrbts	[0..1]	+	Elements characterising a financial instrument.	Elementos que caracterizam um instrumento.	
2.2.2.2.2.7.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	R8
2.2.2.2.2.8		UnderlyingFinancialInstrumentIdentification	UndrlygFinInstrmId	[1..1]	+	Provides underlying financial instrument identification.	Informação de identificação do instrumento financeiro subjacente.	
2.2.2.2.2.8.1		OtherIdentification	OthrId	[1..1]	+	Identification of a security by proprietary or domestic identification scheme.	Identificação proprietária de um instrumento.	
2.2.2.2.2.8.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Identification of a security. Instrument sequential code in the Trade Structure system. (Security ID).	Identificação de um instrumento. Código sequencial do instrumento no sistema Trade Structure. (Security ID).	
2.2.2.2.2.8.1		Type	Tp	[1..1]	+	Identification type.	Tipo da identificação.	

.2								
2.2.2.2.2.8.1.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identification source using a proprietary identification scheme. Valid Values: 8. (Security source).	Identificação única e inequívoca usando um esquema de identificação proprietária. Valores válidos 8. (Security source).	
2.2.2.2.2.8.2		PlaceOfListing	PlcOfListg	[1..1]	+	Market on which the security is listed.	Mercado em que o instrumento está listado.	
2.2.2.2.2.8.2.1		MarketIdentifierCode	MktIdrCd	[1..1]	MICIdentifier	Market Identifier Code. Identification of a financial market, as stipulated in the norm ISO 10383 "Codes for exchanges and market identifications". This tag is optional and if no Security Exchange is provided - it is assumed to be a BVMF instrument. Default Value = "BVMF" (SecurityExchange)	Código identificador do Mercado em que o instrumento está listado. Identificação do Mercado financeiro, conforme estipulado na norma ISO 10383 . Default = "BVMF". (SecurityExchange)	
2.2.2.2.2.9		UnderlyingSecurityIdentification	UndrlygSctyId	[1..1]	+	This block contains the underlying ticker symbol.	Este bloco contém informações de ISIN e código de negociação (subjacentes).	
2.2.2.2.2.9.1		ISIN	ISIN	[1..1]	ISINIdentifier	International Securities Identification Number (ISIN). A numbering system designed by the United Nation's International Organisation for Standardisation (ISO). The ISIN is composed of a 2-character prefix representing the country of issue, followed by the national security number (if one exists), and a check digit. Each country has a national numbering agency that assigns ISIN numbers for securities in that country.	INTERNATIONAL SECURITIES IDENTIFICATION NUMBER - É uma padronização internacional na codificação de títulos financeiros, atribuindo a cada ativo um código único de identificação. O código para os títulos e valores mobiliários brasileiros apresenta a estrutura BR AAAA BBB CC 7 onde: a) os dois primeiros caracteres (BR) identificam o código do BRASIL. b) os quatro caracteres (AAAA) são alfanuméricos e identificam o emissor. c) os três caracteres (BBB) são alfanuméricos e identificam o tipo de ativo, podendo ter seqüência automática na segunda posição (Seqüência 1) e na terceira posição (Seqüência 2) ou não ter qualquer seqüência. d) os dois caracteres (CC) são alfanuméricos e identificam a espécie, quando se tratar de ações, ou representam uma seqüência automática, para identificar cada emissão de título e	

							valor mobiliário, quando se tratar de outras categorias. e) o último caracter (7) é o dígito de controle	
2.2.2.2.2.9.2		TickerSymbol	TckrSymb	[1..1]	TickerIdentifier	Letters that identify a stock traded on a stock exchange. The Ticker Symbol is a short and convenient way of identifying a stock, eg, BVMF3	Letras que identificam uma ação negociada em bolsa de valores. O código de negociação composto pelas letras é uma forma curta e conveniente de identificar uma ação. Ex:BVMF3	
2.2.2.2.2.10		UnderlyingFinancialInstrumentAttributes	UndrlygFinInstrmAttrbts	[1..1]	+	Elements characterising a underlying financial instrument.	Caracteríticas do instrumento financeiro (subjacente).	
2.2.2.2.2.10.1		DistributionIdentification	DstrbtnId	[1..1]	int	Distribution code of the paper corresponding to the active state of law.	Número de distribuição do papel.	
2.2.2.2.2.11		ExpirationDate	XprtnDt	[1..1]	ISODate	Date when the contract expires.	Data Expiração do contrato.	
2.2.2.2.2.12		CurrentFactor	CurFctr	[0..1]	BaseOneRate	Rate expressed as a decimal between 0 and 1 defining the outstanding principal of the financial instrument (for factored securities).	Fator de cotação do instrumento.	
2.2.2.2.2.13		SubAccount	SubAcct	[1..1]	Max5Text	Sub account identification.	Identificação da carteira na depositária	
2.2.2.2.2.14		TradeInformation	TradInf	[1..1]	+	Provides Trade Information.	Informação sobre a negociação.	
2.2.2.2.2.14.1		TradeDate	TradDt	[1..1]	ISODate	Provides the trade date.	Fornece a data do pregão.	
2.2.2.2.2.14.2		TradeIdentification	TradId	[1..1]	Max35Text	Trade identification.	Número do negócio.	
2.2.2.2.2.14.3		OriginalQuantity	OrgnlQty	[1..1]	DecimalNumber	Provides original quantity information.	Quantidade original.	
2.2.2.2.2.15		SettlementDetails	SttlmDtls	[1..1]	+	Provides details about settlement.	Fornece detalhes sobre a liquidação.	
2.2.2.2.2.15.1		ForwardSettlementType	FwdSttlmTp	[0..1]	ExternalFowardSettlementTypeCode	Forward and Securities Lending Settlement Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalFowardSettlementTypeCode in	Tipo de liquidação de termo e aluguel de ativos. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalFowardSettlementTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	

						the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.		
2.2.2.2.2.2.15.2		EarlySettledQuantity	EarlySttldQty	[1..1]	DecimalNumber	Early Settled quantity.	Quantidade antecipada liquidada contrato.	
2.2.2.2.2.2.15.3		CurrentQuantity	CurQty	[1..1]	DecimalNumber	Current quantity.	Quantidade atual do contrato.	
2.2.2.2.2.2.15.4		SettlementDate	SttlmDt	[1..1]	ISODate	Settlement date.	Data de liquidação.	
2.2.2.2.2.2.15.5		EarlySettlementRequestDate	EarlySttlmReqDt	[0..1]	ISODate	Early settlement request date	Data da solicitação de liquidação.	
2.2.2.2.2.2.15.6		SettlementValue	SttlmVal	[0..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Value that will be settled.	Valor que será liquidado.	
2.2.2.2.2.2.15.7	{OR	ForwardDetails	FwdDtls	[1..1]	+	Provides details about fowards (equities and gold).	Fornece detalhes do contrato de termos (ações e ouro).	
2.2.2.2.2.2.15.7.1		ForwardPrice	FwdPric	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Price of the forward contract.	Preço do contrato a termo.	
2.2.2.2.2.2.15.7.2		ExpirationCode	XprtnCd	[0..1]	Max4Text	Expiration code of a Future or an Option. E.g: If Future: MYY: M : Month Code YY: Year Code (Two last digits of year) If Option: MYOA: M: Month Code, Y: Year Code, O: Option Type A: Alphanumeric Sequence	Código de vencimento de um Futuro ou de uma Opção. Ex.: Se Futuro: MMY: M: Código do mês YY: Código do ano (dois últimos dígitos do ano) Se Opção: MYOA: M: Código do mês Y: Código do ano O: Tipo da opção A: Sequencial alfanumérico	R1
2.2.2.2.2.2.15.7.3		EquityForwardType	EqtyFwdTp	[1..1]	ExternalEquityForwardTypeCode	Equity forward type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a	Tipo de Termo. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram	

						flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalEquityForwardTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalEquityForwardTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.2.15.7.4		CancelIndicator	CclInd	[1..1]	YesNoIndicator	It indicates if the early settlement was cancelled.	Indica se a liquidação antecipada foi cancelada.	
2.2.2.2.2.2.15.7.5		ForwardStatusRequest	FwdStsReq	[1..1]	ExternalForwardStatusCode	Forward Status Request. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalForwardStatusCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Status do contrato de termos (ações e ouro). Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalForwardStatusCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.2.15.8	OR}	SecuritiesLendingDetails	SctiesLndgDtls	[1..1]	+	Provides detailas about securities lending.	Fornece detalhes sobre os contratos de aluguel de ativos.	
2.2.2.2.2.2.15.8.1		SecuritiesLendingContractType	SctiesLndgCtrctTp	[0..1]	ExternalSecuritiesLendingContractTypeCode	Securities Lending Contract Type. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalSecuritiesLendingContractTypeCode in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls.	Tipo de contrato de aluguel de ativos. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalSecuritiesLendingContractTypeCode no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls.	
2.2.2.2.2.2.15.8.2		LastPossibleSettlementDate	LastPssblSttlmDt	[0..1]	ISODate	This is the maximum date for settlement of the contract by the borrower.	Esta é a data máxima para liquidação do contrato pelo tomador.	
2.2.2.2.2.2.15.8.3		LenderRate	LndrRate	[0..1]	PercentageRate	Lender contract rate.	Taxa do doador do contrato.	R2
2.2.2.2.2.2.15.8.4		LenderBrokerCommission	LndrBrkrComssn	[0..1]	PercentageRate	Lender contract commission.	Comissão do participante doador do contrato.	R6
2.2.2.2.2.2.15.8.5		BorrowerRate	BrrwrRate	[0..1]	PercentageRate	Borrower contract rate, composed by the sum of the lender´s rate and commission.	Taxa do tomador do contrato, composta pela soma da taxa do doador e comissão da participante doador.	R3
2.2.2.2.2.2.15.		BorrowerBrokerCom	BrrwrBrkr	[0..1]	PercentageRate	Borrower contract commission.	Comissão do participante tomador do	R3

8.6		mission	Comssn				contrato.	
2.2.2.2.2.2.15.8.7		BorrowerFinalRate	BrrwrFnlRate	[0..1]	PercentageRate	Final Rate = Lender rate + lender broker commission + borrower broker commission.	Composta pela soma da Taxa do Doador e Comissão dos Participantes Tomador e Doador.	R4
2.2.2.2.2.2.15.8.8		GiveUpPartyInformation	GvUpPtyInf	[0..1]	+	Provides details about the give up party identification and account.	Fornece detalhes da identificação do participante e conta, origem da indicação.	R2
2.2.2.2.2.2.15.8.8.1		PartyIdentification	PtyId	[1..1]	+	Provides details about the party identification.	Fornece detalhes de identificação do participante.	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.1.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.1.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.1.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.1.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.2		AccountIdentification	AcctId	[1..1]	+	Provides account identification.	Fornece dados de identificação da conta.	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.2.1		Proprietary	Prtry	[1..1]	+	Unique identifier for an account. It is assigned by the account servicer using a proprietary identification scheme.	Identificador único para uma conta, usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.2.15.8.8.2.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Number account identification. Unique identification for the account	Número de identificação da conta.	

						investors. e.g 115 = Account Number	Identificação única para a conta do investidor. Ex: 115 = Número da Conta	
2.2.2.2.2.2.15.8.9		AnonymityIndicator	AnmtyInd	[1..1]	YesNoIndicator	Anonymous contract indicator.	Indicador de contrato anônimo.	
2.2.2.2.2.2.15.8.10		CounterPartyIdentification	CntrPtyId	[0..1]	+	Provides details about the counterparty identification.	Fornece detalhes de identificação da contraparte.	R5
2.2.2.2.2.2.15.8.10.1		ProprietaryIdentification	PrtryId	[1..1]	+	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme.	Identificação única atribuída a uma instituição usando um schema de identificação proprietária.	
2.2.2.2.2.2.15.8.10.1.1		Identification	Id	[1..1]	Max35Text	Unique and unambiguous identifier, as assigned to a financial institution using a proprietary identification scheme. This field requires an external code list. Those codes and values have been made external spreadsheet files to allow a flexible maintenance according to the updates requirements from BM&FBOVESPA. In this case the external identification is ExternalRole in the file ExternalCodeLists_BVMF.xls. The identification of the party must be informed in the standard below: Role+PartyIdentification e.g 3-123456, where 3 means TP (Trading Participant).	Identificação única como é conhecida uma instituição usando um schema de identificação proprietária. Este campo requer uma lista de código externo. Esses códigos e valores foram feitos em planilhas externas para permitir a manutenção de acordo com os requisitos de atualizações da BM&FBOVESPA. Neste caso o externo é ExternalRole no arquivo ExternalCodeLists_BVMF.xls. A identificação do participante precisa ser informada no padrão abaixo: Categoria+Identificação do Participante ex: 3-123456, onde 3 significa PNP (Participante de Negociação Pleno).	
2.2.2.2.2.2.15.8.10.1.2		Issuer	Issr	[1..1]	Max35Text	Entity that assigns the identification.e.g BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 40.	Entidade que emitiu a identificação. Ex: BM&FBOVESPA . Este campo deve ser preenchido com o valor default = 40.	
2.2.2.2.2.2.15.8.10.1.3		SchemeName	SchmeNm	[1..1]	Max35Text	Identification type code. E.g. CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. This field should be filled with default value = 39.	Código do tipo de documento. Ex: CÓDIGO PARTICIPANTE BM&FBOVESPA. Este campo deve ser preenchido com o valor default = 39.	
2.2.2.2.2.2.15.8.11		UnderlyingPreviousDayClosingPrice	UndrlygPrvsDayClsgPric	[1..1]	RestrictedBVMF2ActiveOrHistoricCurrencyAnd4DecimalAmount	Previous day´s underlying closing price.	Preço de fechamento do dia anterior (subjacente).	